

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

104年5月

單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	本國銀行及外國銀行在台分行 ¹			
	涉及新臺幣交易	純外幣交易	合 計	比 重
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	219,388	542,122	761,510	5.48
(一)店頭市場(OTC)	219,388	112,589	331,977	2.39
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	429,533	429,533	3.09
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,393,471	8,384,592	12,778,063	92.05
(一)店頭市場(OTC)	4,393,471	8,384,592	12,778,063	92.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	-	-	-
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	311,184	5,255	316,439	2.28
(一)店頭市場(OTC)	89	496	585	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	311,095	4,759	315,854	2.28
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	590	23,780	24,370	0.18
(一)店頭市場(OTC)	-	10,526	10,526	0.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	590	13,254	13,844	0.10
小 計(一至四)	4,924,633	8,955,749	13,880,382	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,428	1,428	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	4,924,633	8,957,177	13,881,810	100.00

註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

2. 匯率有關—遠期契約中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

交 易 幣 別 比 較

單位：新臺幣百萬元；%

交 易 幣 別		涉及新臺幣交易	純外幣交易	合 計
104年5月	金 額	4,924,633	8,957,177	13,881,810
	比 重	35.48	64.52	100.00
104年4月	金 額	5,169,152	8,569,060	13,738,212
	比 重	37.63	62.37	100.00
比較增減	差 額	-244,519	388,117	143,598
	變動率	-4.73	4.53	1.05

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

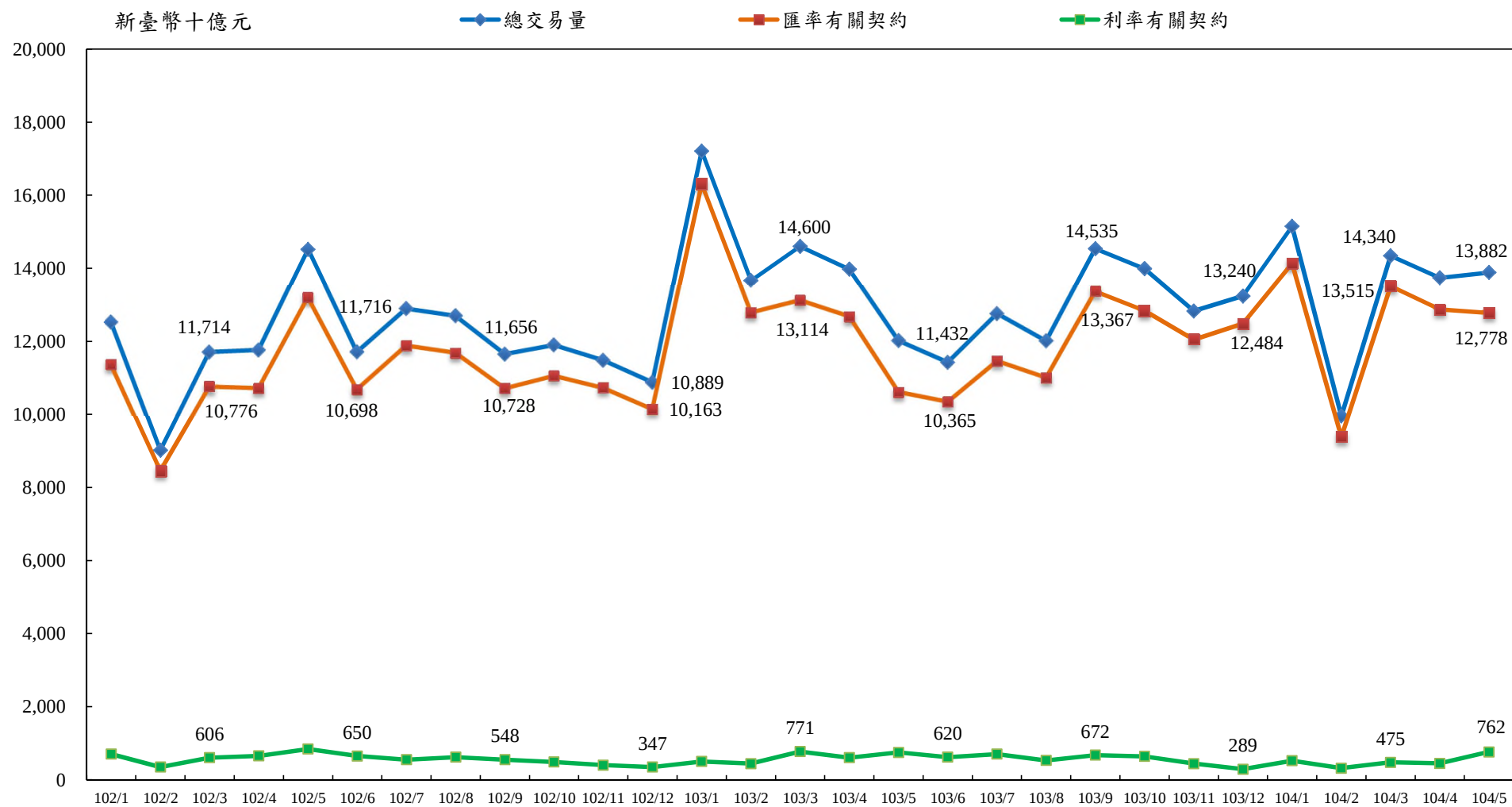
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	104年5月		104年4月		比較增減	
	合計 ¹	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	761,510	5.48	448,767	3.26	312,743	69.69
(一)店頭市場(OTC)	331,977	2.39	99,606	0.72	232,371	233.29
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	321,076	2.31	92,501	0.67	228,575	247.11
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,199	0.02	581	-	1,618	278.49
4. 賣出選擇權(Sold Options)	8,702	0.06	6,524	0.05	2,178	33.38
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	429,533	3.09	349,161	2.54	80,372	23.02
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	210,358	1.52	172,623	1.26	37,735	21.86
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	218,557	1.57	176,536	1.28	42,021	23.80
3. 買入選擇權(Bought Options)	309	-	1	-	308	30,800.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	309	-	1	-	308	30,800.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,778,063	92.05	12,873,806	93.71	-95,743	-0.74
(一)店頭市場(OTC)	12,778,063	92.05	12,873,806	93.71	-95,743	-0.74
1. 遠期契約(Outright Forwards) ²	1,211,954	8.73	1,403,986	10.22	-192,032	-13.68
2. 換匯(Fx Swaps)	8,568,625	61.73	8,400,112	61.15	168,513	2.01
3. 換匯換利(Currency Swaps)	97,724	0.70	63,693	0.46	34,031	53.43
4. 買入選擇權(Bought Options)	1,478,826	10.65	1,532,729	11.16	-53,903	-3.52
5. 賣出選擇權(Sold Options)	1,420,934	10.24	1,473,286	10.72	-52,352	-3.55
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	-	-	-	-	-
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	-	-	-	-	-	-
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	-	-	-	-	-	-
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	316,439	2.28	367,623	2.68	-51,184	-13.92
(一)店頭市場(OTC)	585	-	566	0.01	19	3.36
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	315,854	2.28	367,057	2.67	-51,203	-13.95
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	24,370	0.18	44,681	0.33	-20,311	-45.46
(一)店頭市場(OTC)	10,526	0.08	8,677	0.07	1,849	21.31
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	13,844	0.10	36,004	0.26	-22,160	-61.55
小 計(一至四)	13,880,382	99.99	13,734,877	99.98	145,505	1.06
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,428	0.01	3,335	0.02	-1,907	-57.18
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,428	0.01	3,335	0.02	-1,907	-57.18
2. 買入信用違約選擇權(Bought Credit Default Options)	-	-	-	-	-	-
3. 賣出信用違約選擇權(Sold Credit Default Options)	-	-	-	-	-	-
4. 其他(Other)	-	-	-	-	-	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
1. 遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2. 交換(Swaps)	-	-	-	-	-	-
3. 選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
總 計	13,881,810	100.00	13,738,212	100.00	143,598	1.05

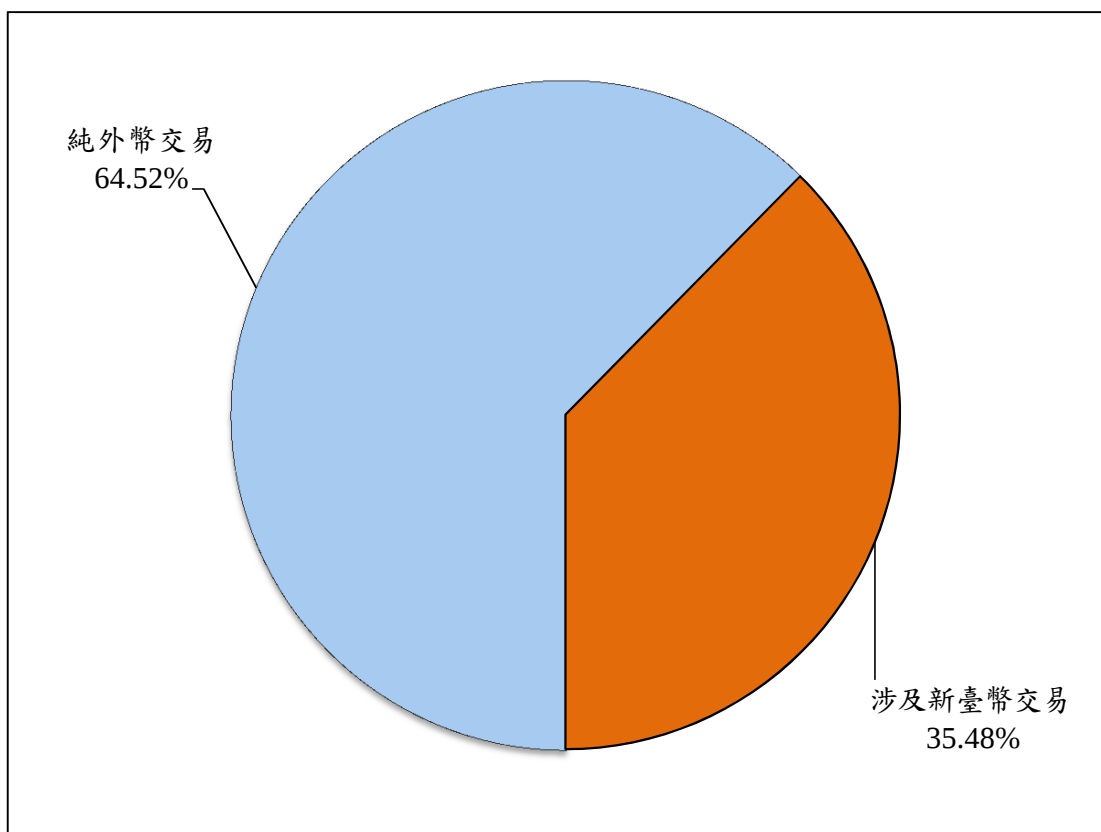
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

2. 匯率有關—遠期契約中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量統計



附圖2 104年5月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

