

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表
商 品 種 類 別

106年4月

單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	本國銀行及外國與大陸地區銀行在台分行 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)	133,790	502,116	635,906	6.09
(一)店頭市場(OTC)	133,396	88,706	222,102	2.13
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	394	413,410	413,804	3.96
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5,238,340	4,129,240	9,367,580	89.77
(一)店頭市場(OTC)	5,238,340	4,103,619	9,341,959	89.52
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	25,621	25,621	0.25
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	415,847	3,424	419,271	4.02
(一)店頭市場(OTC)	10	192	202	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	415,837	3,232	419,069	4.02
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	811	8,393	9,204	0.09
(一)店頭市場(OTC)	-	7,102	7,102	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	811	1,291	2,102	0.02
小 計(一至四)	5,788,788	4,643,173	10,431,961	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3,285	3,285	0.03
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,788,788	4,646,458	10,435,246	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
106年4月	金 額	5,788,788	4,646,458	10,435,246
	比 重	55.47	44.53	100.00
106年3月	金 額	7,816,455	6,857,679	14,674,134
	比 重	53.27	46.73	100.00
比較增減	差 額	-2,027,667	-2,211,221	-4,238,888
	變動率	-25.94	-32.24	-28.89

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；%

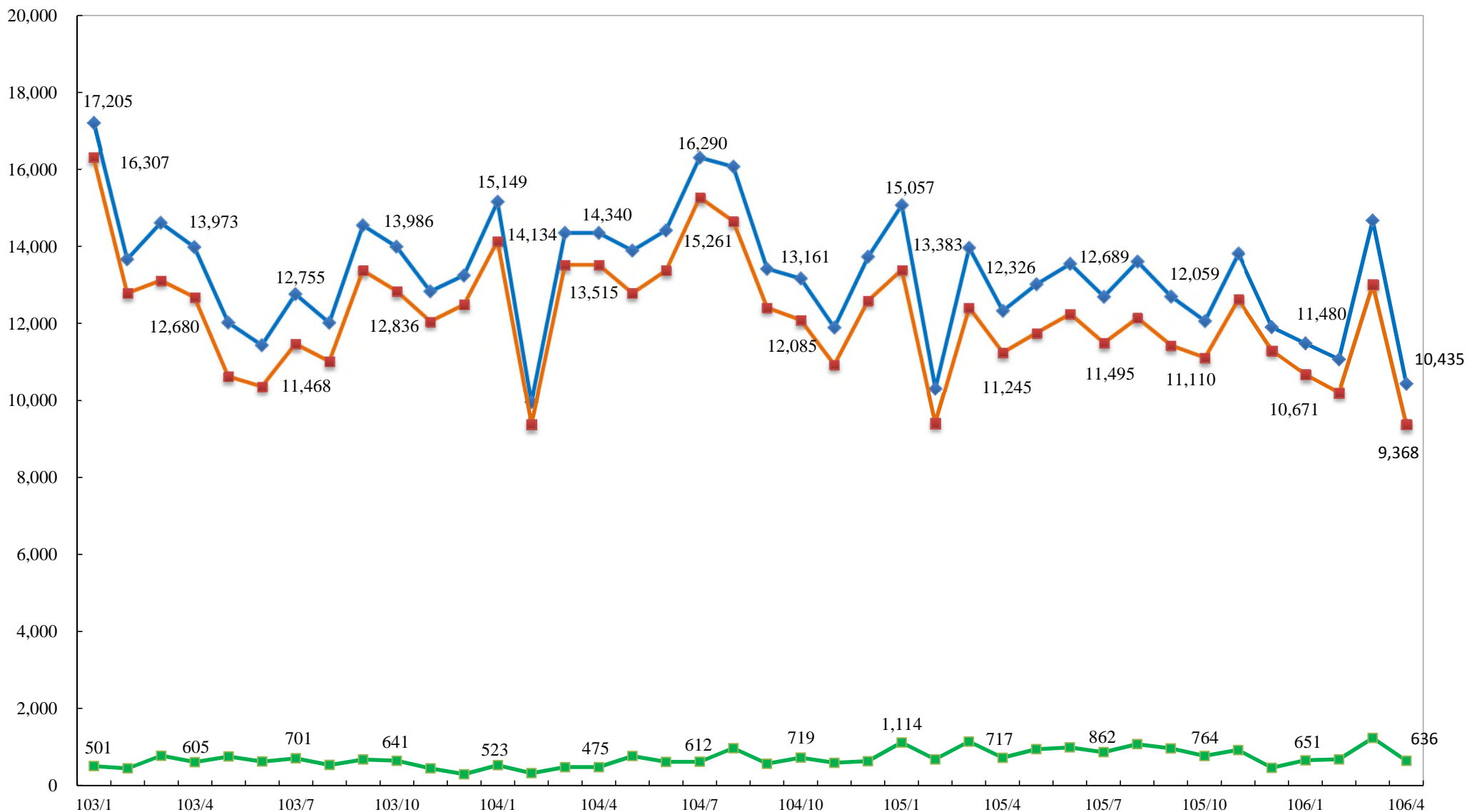
商 品 種 類	106年4月		106年3月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	635,906	6.09	1,231,026	8.39	-595,120	-48.34
(一)店頭市場(OTC)	222,102	2.13	523,266	3.57	-301,164	-57.55
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	211,590	2.03	467,567	3.19	-255,977	-54.75
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	650	-	-650	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	10,512	0.10	55,049	0.38	-44,537	-80.90
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	413,804	3.96	707,760	4.82	-293,956	-41.53
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	221,130	2.12	300,985	2.05	-79,855	-26.53
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	191,418	1.83	406,540	2.77	-215,122	-52.92
3. 買入選擇權(Bought Options)	544	-	152	-	392	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	712	0.01	83	-	629	757.83
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	9,367,580	89.77	13,008,025	88.65	-3,640,445	-27.99
(一)店頭市場(OTC)	9,341,959	89.52	12,950,037	88.25	-3,608,078	-27.86
1. 遠期契約(Outright Forwards)	897,914	8.60	1,437,117	9.79	-539,203	-37.52
2. 換匯(Fx Swaps)	7,839,886	75.13	10,506,889	71.60	-2,667,003	-25.38
3. 換匯換利(Currency Swaps)	54,760	0.53	192,340	1.31	-137,580	-71.53
4. 買入選擇權(Bought Options)	279,801	2.68	404,912	2.76	-125,111	-30.90
5. 賣出選擇權(Sold Options)	269,598	2.58	408,779	2.79	-139,181	-34.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	25,621	0.25	57,988	0.40	-32,367	-55.82
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	9,707	0.09	25,039	0.17	-15,332	-61.23
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	9,897	0.10	24,773	0.17	-14,876	-60.05
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,216	0.03	4,283	0.03	-1,067	-24.91
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,801	0.03	3,893	0.03	-1,092	-28.05
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	419,271	4.02	416,376	2.84	2,895	0.70
(一)店頭市場(OTC)	202	-	430	-	-228	-53.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	419,069	4.02	415,946	2.84	3,123	0.75
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	9,204	0.09	15,288	0.10	-6,084	-39.80
(一)店頭市場(OTC)	7,102	0.07	11,332	0.08	-4,230	-37.33
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,102	0.02	3,956	0.02	-1,854	-46.87
小 計(一至四)	10,431,961	99.97	14,670,715	99.98	-4,238,754	-28.89
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,285	0.03	3,419	0.02	-134	-3.92
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	3,285	0.03	3,419	0.02	-134	-3.92
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^註	10,435,246	100.00	14,674,134	100.00	-4,238,888	-28.89

註：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。

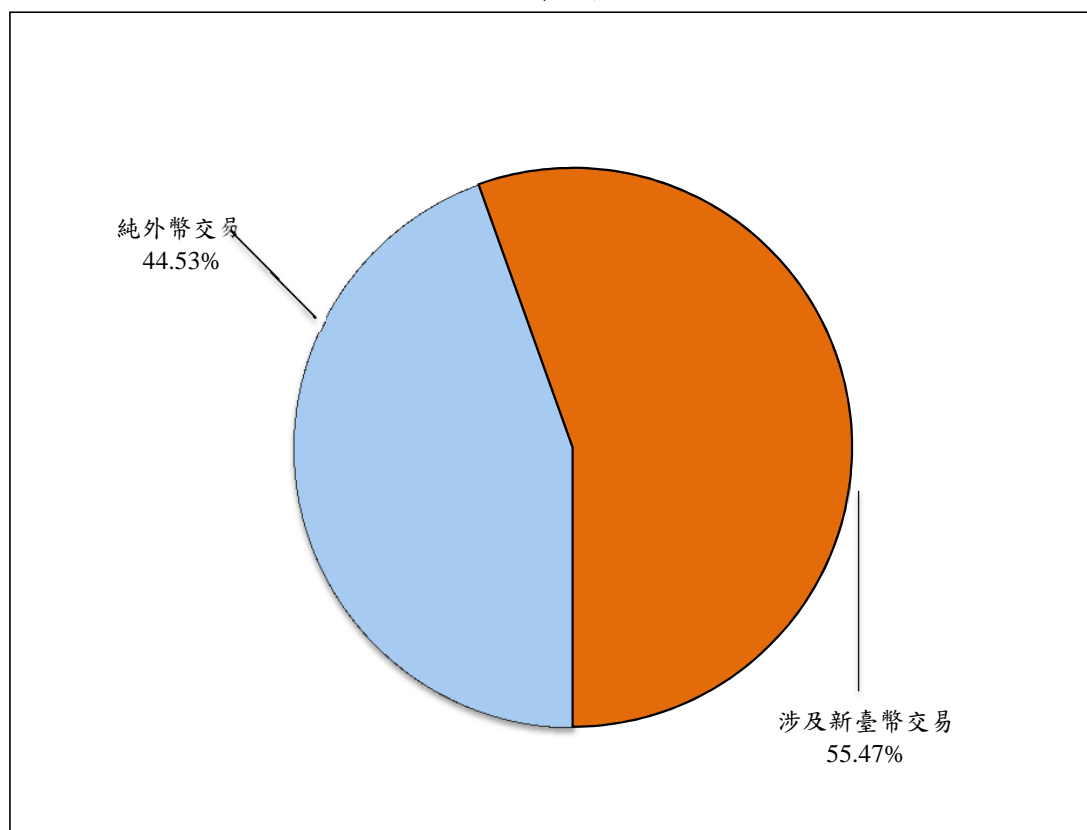
附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量趨勢統計

◆ 總交易量
 ■ 匯率有關契約
 ■ 利率有關契約

新臺幣十億元



附圖2 106年4月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

