

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5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)	141, 023	715, 516	856, 539	7. 32
(一)店頭市場(OTC)	140, 871	118, 776	259, 647	2. 22
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	152	596, 740	596, 892	5. 10
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5, 548, 178	4, 760, 673	10, 308, 851	88. 10
(一)店頭市場(OTC)	5, 548, 178	4, 712, 108	10, 260, 286	87. 69
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	48, 565	48, 565	0. 41
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	519, 502	2, 908	522, 410	4. 47
(一)店頭市場(OTC)	-	42	42	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	519, 502	2, 866	522, 368	4. 47
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	730	9, 004	9, 734	0. 08
(一)店頭市場(OTC)	-	7, 078	7, 078	0. 06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	730	1, 926	2, 656	0. 02
小 計(一至四)	6, 209, 433	5, 488, 101	11, 697, 534	99. 97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3, 655	3, 655	0. 03
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6, 209, 433	5, 491, 756	11, 701, 189	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5月	金 額	6, 209, 433	5, 491, 756	11, 701, 189
	比 重	53. 07	46. 93	100. 00
106年4月	金 額	5, 788, 788	4, 646, 458	10, 435, 246
	比 重	55. 47	44. 53	100. 00
比較增減	差 額	420, 645	845, 298	1, 265, 943
	變動率	7. 27	18. 19	12. 13

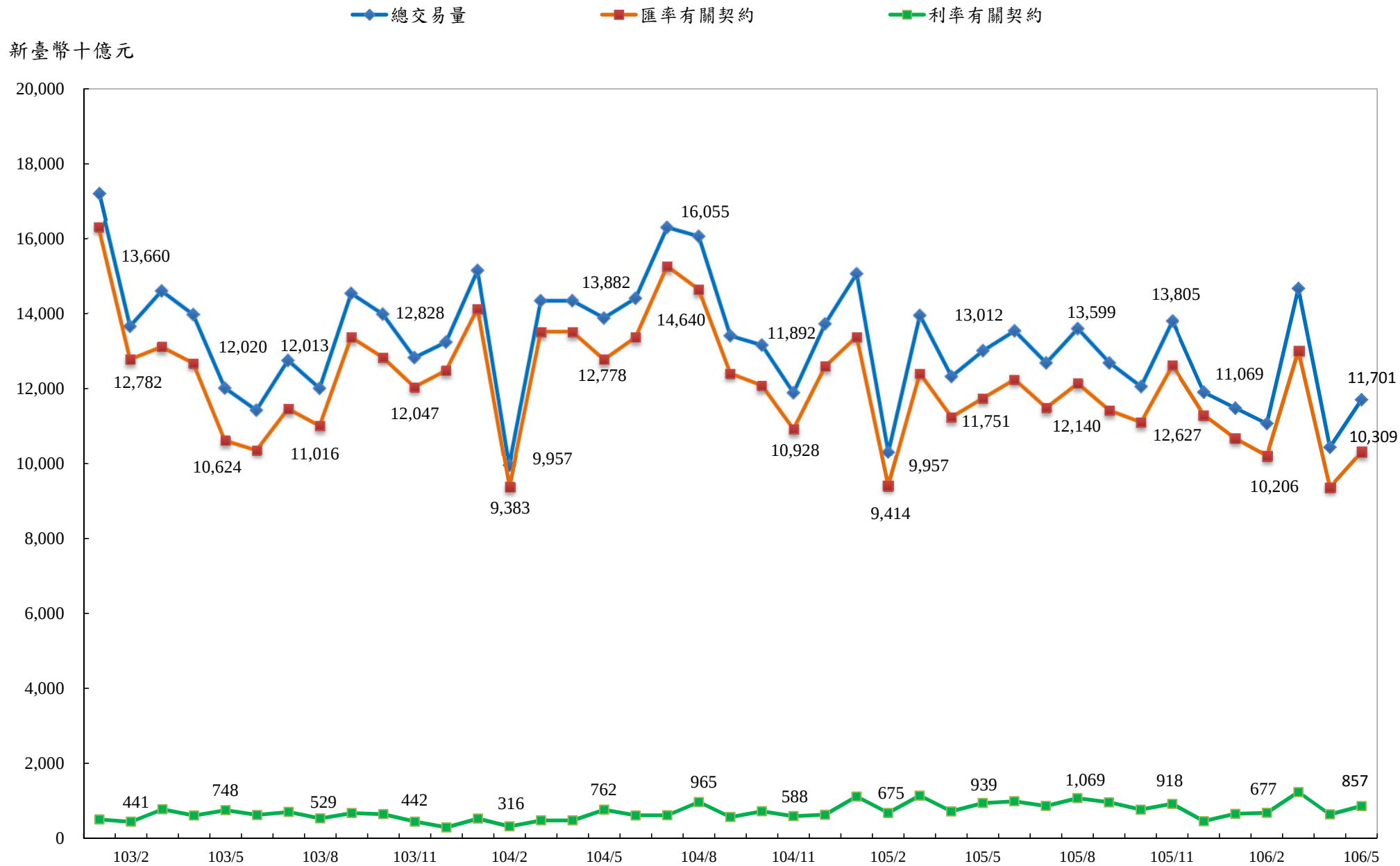
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

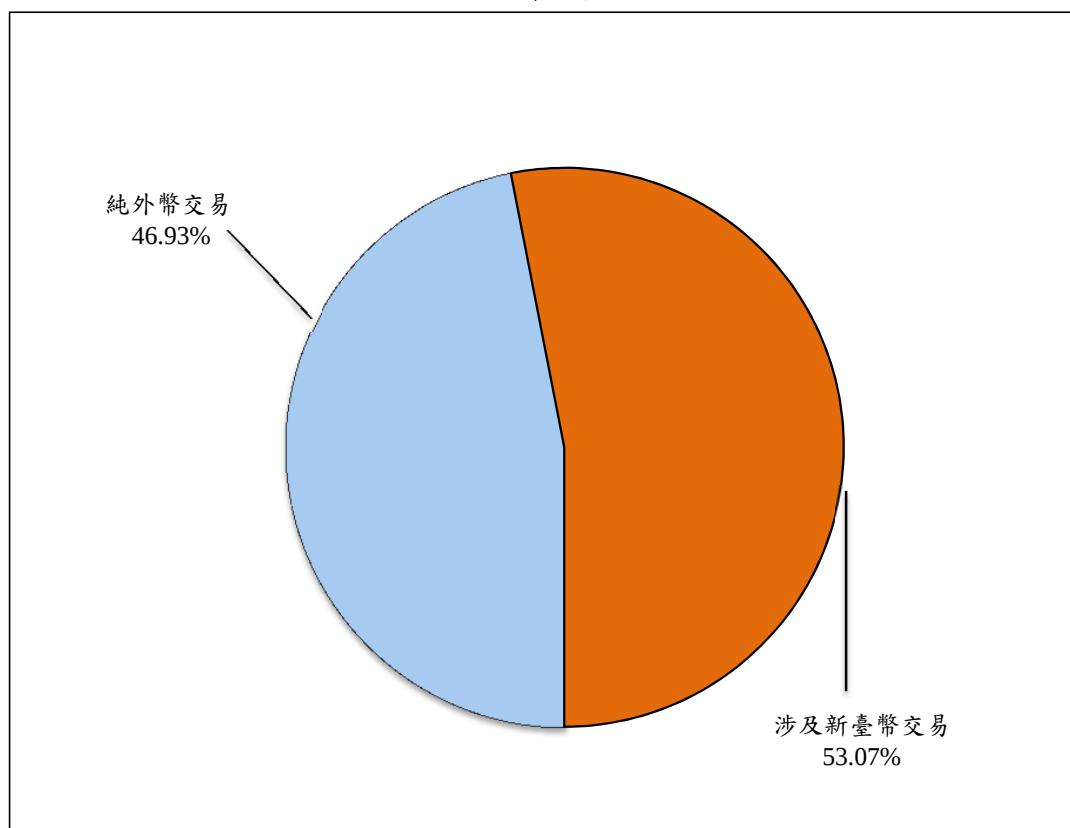
商 品 種 類	106年5月		106年4月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	856,539	7.32	635,906	6.09	220,633	34.70
(一)店頭市場(OTC)	259,647	2.22	222,102	2.13	37,545	16.90
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	234,987	2.01	211,590	2.03	23,397	11.06
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	24,660	0.21	10,512	0.10	14,148	134.59
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	596,892	5.10	413,804	3.96	183,088	44.25
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	302,737	2.59	221,130	2.12	81,607	36.90
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	293,503	2.51	191,418	1.83	102,085	53.33
3. 買入選擇權(Bought Options)	301	-	544	-	-243	-44.67
4. 賣出選擇權(Sold Options)	351	-	712	0.01	-361	-50.70
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,308,851	88.10	9,367,580	89.77	941,271	10.05
(一)店頭市場(OTC)	10,260,286	87.69	9,341,959	89.52	918,327	9.83
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,009,247	8.63	897,914	8.60	111,333	12.40
2. 換匯(Fx Swaps)	8,578,042	73.31	7,839,886	75.13	738,156	9.42
3. 換匯換利(Currency Swaps)	66,466	0.57	54,760	0.53	11,706	21.38
4. 買入選擇權(Bought Options)	308,300	2.63	279,801	2.68	28,499	10.19
5. 賣出選擇權(Sold Options)	298,231	2.55	269,598	2.58	28,633	10.62
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	48,565	0.41	25,621	0.25	22,944	89.55
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	19,279	0.16	9,707	0.09	9,572	98.61
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	19,590	0.17	9,897	0.10	9,693	97.94
3. 買入選擇權(Bought Options)	5,151	0.04	3,216	0.03	1,935	60.17
4. 賣出選擇權(Sold Options)	4,545	0.04	2,801	0.03	1,744	62.26
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	522,410	4.47	419,271	4.02	103,139	24.60
(一)店頭市場(OTC)	42	-	202	-	-160	-79.21
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	522,368	4.47	419,069	4.02	103,299	24.65
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	9,734	0.08	9,204	0.09	530	5.76
(一)店頭市場(OTC)	7,078	0.06	7,102	0.07	-24	-0.34
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,656	0.02	2,102	0.02	554	26.36
小 計(一至四)	11,697,534	99.97	10,431,961	99.97	1,265,573	12.13
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,655	0.03	3,285	0.03	370	11.26
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	3,655	0.03	3,285	0.03	370	11.26
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	11,701,189	100.00	10,435,246	100.00	1,265,943	12.13

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



附圖2 106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

