

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

107年3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)	353,547	1,539,293	1,892,840	12.24
(一)店頭市場(OTC)	353,162	365,741	718,903	4.65
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	385	1,173,552	1,173,937	7.59
二、匯率有關契約 ² (Foreign Exchange Transactions)	6,796,345	6,429,805	13,226,150	85.51
(一)店頭市場(OTC)	6,796,345	6,378,062	13,174,407	85.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	51,743	51,743	0.33
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	286,755	34,569	321,324	2.07
(一)店頭市場(OTC)	5	2,348	2,353	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	286,750	32,221	318,971	2.06
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	763	13,145	13,908	0.09
(一)店頭市場(OTC)	-	7,936	7,936	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	763	5,209	5,972	0.04
小 計(一至四)	7,437,410	8,016,812	15,454,222	99.91
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	13,320	13,320	0.09
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,437,410	8,030,132	15,467,542	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
107年3月	金 額	7,437,410	8,030,132	15,467,542
	比 重	48.08	51.92	100.00
107年2月	金 額	5,079,840	6,080,443	11,160,283
	比 重	45.52	54.48	100.00
比較增減	差 額	2,357,570	1,949,689	4,307,259
	變動率	46.41	32.06	38.59

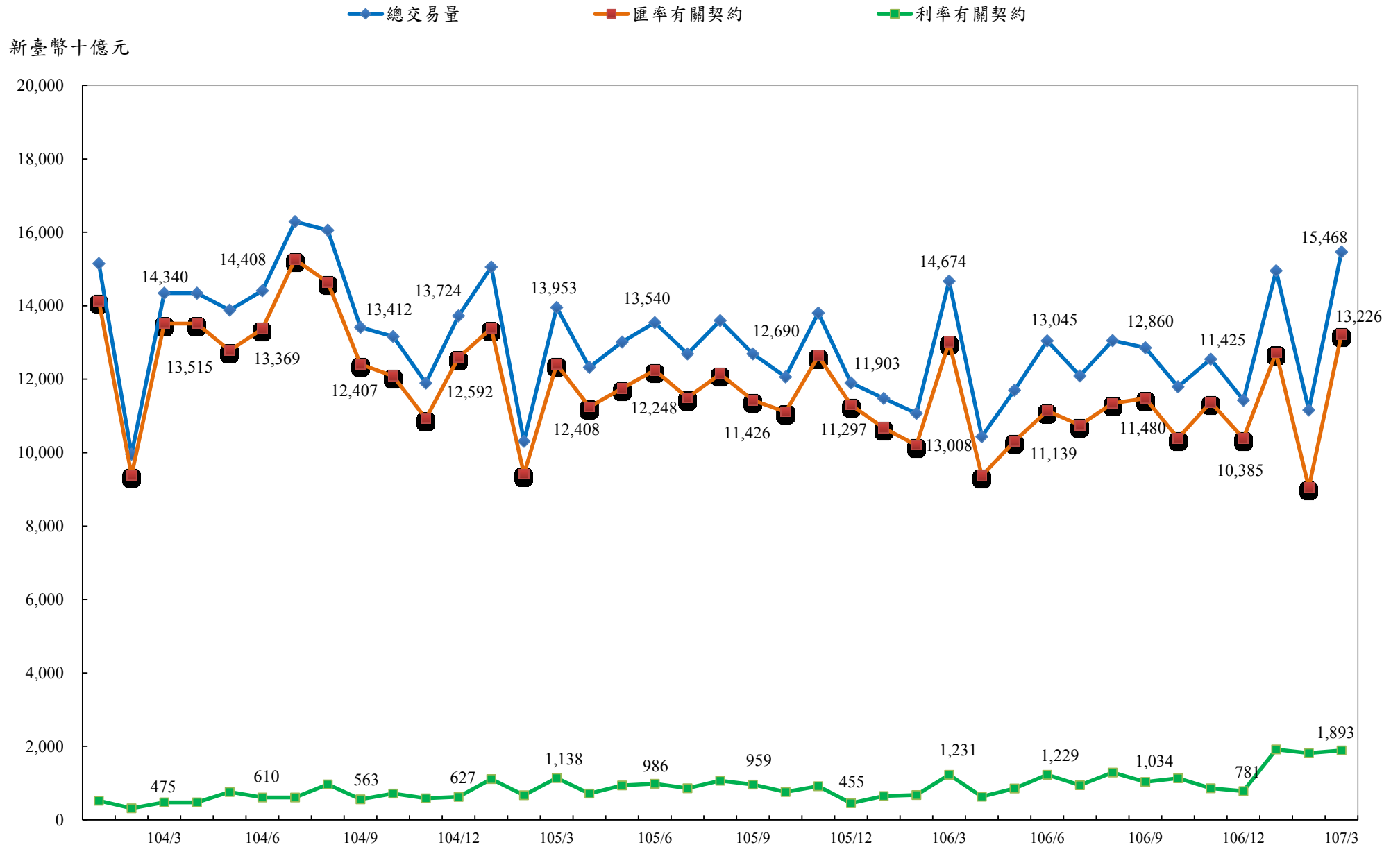
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

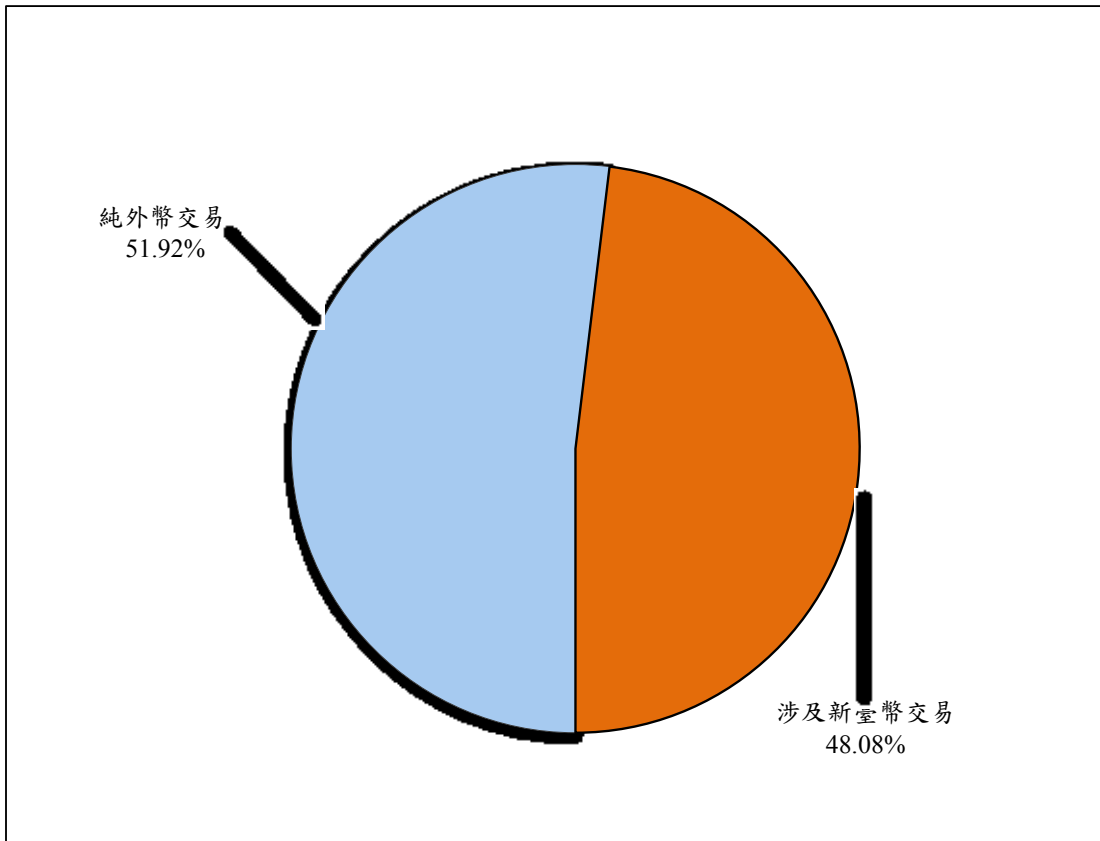
商品種類	107年3月		107年2月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,892,840	12.24	1,815,724	16.27	77,116	4.25
(一)店頭市場(OTC)	718,903	4.65	499,664	4.48	219,239	43.88
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	555,596	3.59	335,857	3.01	219,739	65.43
3. 買入選擇權(Bought Options)	59,603	0.39	4,963	0.05	54,640	1,100.95
4. 賣出選擇權(Sold Options)	103,704	0.67	158,844	1.42	-55,140	-34.71
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,173,937	7.59	1,316,060	11.79	-142,123	-10.80
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	609,233	3.94	660,072	5.91	-50,839	-7.70
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	563,609	3.65	655,366	5.87	-91,757	-14.00
3. 買入選擇權(Bought Options)	553	-	-	-	553	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	542	-	622	0.01	-80	-12.86
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	13,226,150	85.51	9,050,438	81.10	4,175,712	46.14
(一)店頭市場(OTC)	13,174,407	85.18	9,022,734	80.85	4,151,673	46.01
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,208,865	7.82	1,046,998	9.38	161,867	15.46
2. 換匯(Fx Swaps)	11,116,331	71.87	7,432,828	66.60	3,683,503	49.56
3. 換匯換利(Currency Swaps)	156,622	1.01	64,225	0.58	92,397	143.86
4. 買入選擇權(Bought Options)	351,721	2.28	241,848	2.17	109,873	45.43
5. 賣出選擇權(Sold Options)	340,868	2.20	236,835	2.12	104,033	43.93
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	51,743	0.33	27,704	0.25	24,039	86.77
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	18,800	0.12	11,761	0.11	7,039	59.85
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	22,213	0.14	13,021	0.12	9,192	70.59
3. 買入選擇權(Bought Options)	6,129	0.04	1,392	0.01	4,737	340.30
4. 賣出選擇權(Sold Options)	4,601	0.03	1,530	0.01	3,071	200.72
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	321,324	2.07	282,524	2.53	38,800	13.73
(一)店頭市場(OTC)	2,353	0.01	2,353	0.02	-	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	318,971	2.06	280,171	2.51	38,800	13.85
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	13,908	0.09	6,979	0.06	6,929	99.28
(一)店頭市場(OTC)	7,936	0.05	3,763	0.03	4,173	110.90
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,972	0.04	3,216	0.03	2,756	85.70
小計(一至四)	15,454,222	99.91	11,155,665	99.96	4,298,557	38.53
五、信用有關契約(Credit Contracts)	13,320	0.09	4,618	0.04	8,702	188.44
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	13,320	0.09	4,618	0.04	8,702	188.44
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	15,467,542	100.00	11,160,283	100.00	4,307,259	38.59

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2 107年3月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

