

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7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)	179,553	937,842	1,117,395	7.56
（一）店頭市場(OTC)	177,103	142,044	319,147	2.16
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	2,450	795,798	798,248	5.40
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	7,039,279	6,208,710	13,247,989	89.61
（一）店頭市場(OTC)	7,039,279	6,086,299	13,125,578	88.78
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	122,411	122,411	0.83
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	383,629	8,701	392,330	2.65
（一）店頭市場(OTC)	-	719	719	0.00
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	383,629	7,982	391,611	2.65
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	797	13,835	14,632	0.10
（一）店頭市場(OTC)	-	9,668	9,668	0.07
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	797	4,167	4,964	0.03
小 計(一至四)	7,603,258	7,169,088	14,772,346	99.92
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	12,074	12,074	0.08
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,603,258	7,181,162	14,784,420	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7月	金 額	7,603,258	7,181,162	14,784,420
	比 重	51.43	48.57	100.00
107年6月	金 額	7,014,073	7,712,249	14,726,322
	比 重	47.63	52.37	100.00
比較增減	差 額	589,185	-531,087	58,098
	變動率	8.40	-6.89	0.39

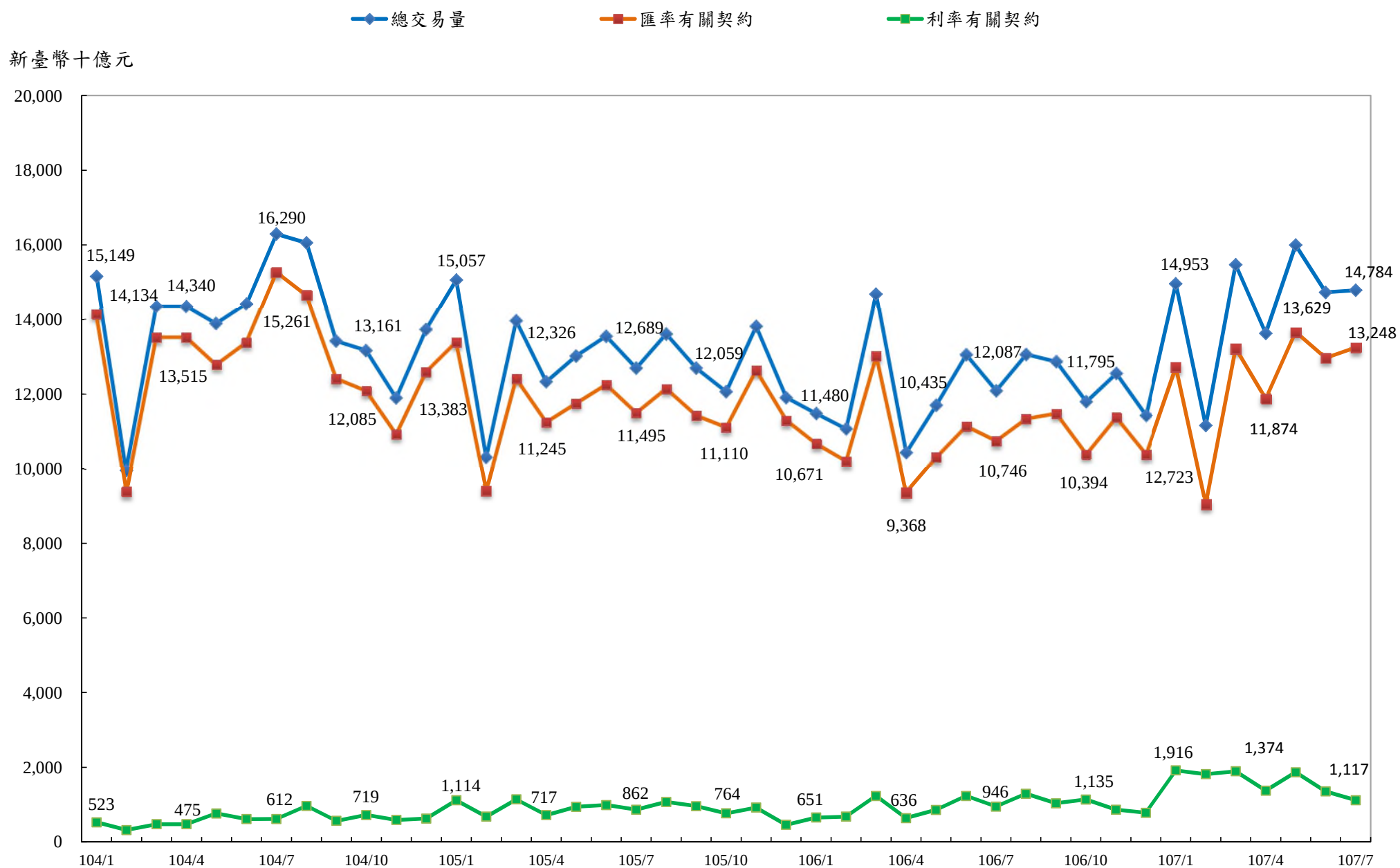
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	107年7月		107年6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)	1,117,395	7.56	1,351,297	9.18	-233,902	-17.31
(一)店頭市場(OTC)	319,147	2.16	551,552	3.75	-232,405	-42.14
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	311,959	2.11	543,620	3.69	-231,661	-42.61
3. 買入選擇權(Bought Options)	292	-	3,458	0.03	-3,166	-91.56
4. 賣出選擇權(Sold Options)	6,896	0.05	4,474	0.03	2,422	54.14
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	798,248	5.40	799,745	5.43	-1,497	-0.19
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	447,676	3.03	386,338	2.62	61,338	15.88
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	350,572	2.37	413,407	2.81	-62,835	-15.20
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	13,247,989	89.61	12,968,373	88.06	279,616	2.16
(一)店頭市場(OTC)	13,125,578	88.78	12,874,350	87.42	251,228	1.95
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,510,196	10.21	1,515,872	10.29	-5,676	-0.37
2. 換匯(Fx Swaps)	10,788,336	72.97	10,607,209	72.03	181,127	1.71
3. 換匯換利(Currency Swaps)	203,800	1.38	66,053	0.45	137,747	208.54
4. 買入選擇權(Bought Options)	321,620	2.18	346,424	2.35	-24,804	-7.16
5. 賣出選擇權(Sold Options)	301,626	2.04	338,792	2.30	-37,166	-10.97
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	122,411	0.83	94,023	0.64	28,388	30.19
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	48,959	0.33	43,079	0.29	5,880	13.65
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	51,630	0.35	42,725	0.29	8,905	20.84
3. 買入選擇權(Bought Options)	11,771	0.08	4,892	0.04	6,879	140.62
4. 賣出選擇權(Sold Options)	10,051	0.07	3,327	0.02	6,724	202.10
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	392,330	2.65	383,739	2.61	8,591	2.24
(一)店頭市場(OTC)	719	-	806	0.01	-87	-10.79
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	391,611	2.65	382,933	2.60	8,678	2.27
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	14,632	0.10	15,030	0.10	-398	-2.65
(一)店頭市場(OTC)	9,668	0.07	12,028	0.08	-2,360	-19.62
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,964	0.03	3,002	0.02	1,962	65.36
小 計(一至四)	14,772,346	99.92	14,718,439	99.95	53,907	0.37
五、信用有關契約(Credit Contracts)	12,074	0.08	7,883	0.05	4,191	53.17
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	12,074	0.08	7,883	0.05	4,191	53.17
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	14,784,420	100.00	14,726,322	100.00	58,098	0.39

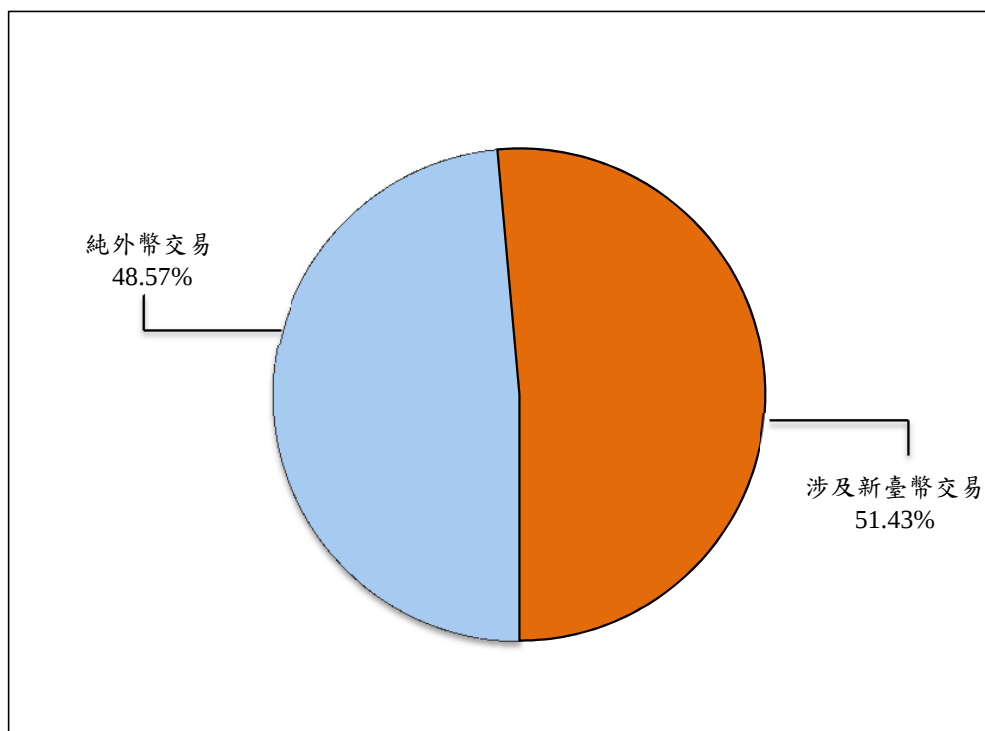
註：包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

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7月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

