

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)	353, 927	1, 509, 904	1, 863, 831	11. 65
（一）店頭市場(OTC)	351, 349	277, 162	628, 511	3. 93
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	2, 578	1, 232, 742	1, 235, 320	7. 72
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	6, 972, 738	6, 692, 515	13, 665, 253	85. 44
（一）店頭市場(OTC)	6, 972, 738	6, 595, 232	13, 567, 970	84. 83
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	97, 283	97, 283	0. 61
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	418, 715	23, 131	441, 846	2. 76
（一）店頭市場(OTC)	21	1, 680	1, 701	0. 01
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	418, 694	21, 451	440, 145	2. 75
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	733	15, 522	16, 255	0. 10
（一）店頭市場(OTC)	-	10, 037	10, 037	0. 06
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	733	5, 485	6, 218	0. 04
小 計(一至四)	7, 746, 113	8, 241, 072	15, 987, 185	99. 95
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	6, 998	6, 998	0. 05
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7, 746, 113	8, 248, 070	15, 994, 183	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5月	金 額	7, 746, 113	8, 248, 070	15, 994, 183
	比 重	48. 43	51. 57	100. 00
107年4月	金 額	6, 817, 622	6, 811, 200	13, 628, 822
	比 重	50. 02	49. 98	100. 00
比較增減	差 額	928, 491	1, 436, 870	2, 365, 361
	變動率	13. 62	21. 10	17. 36

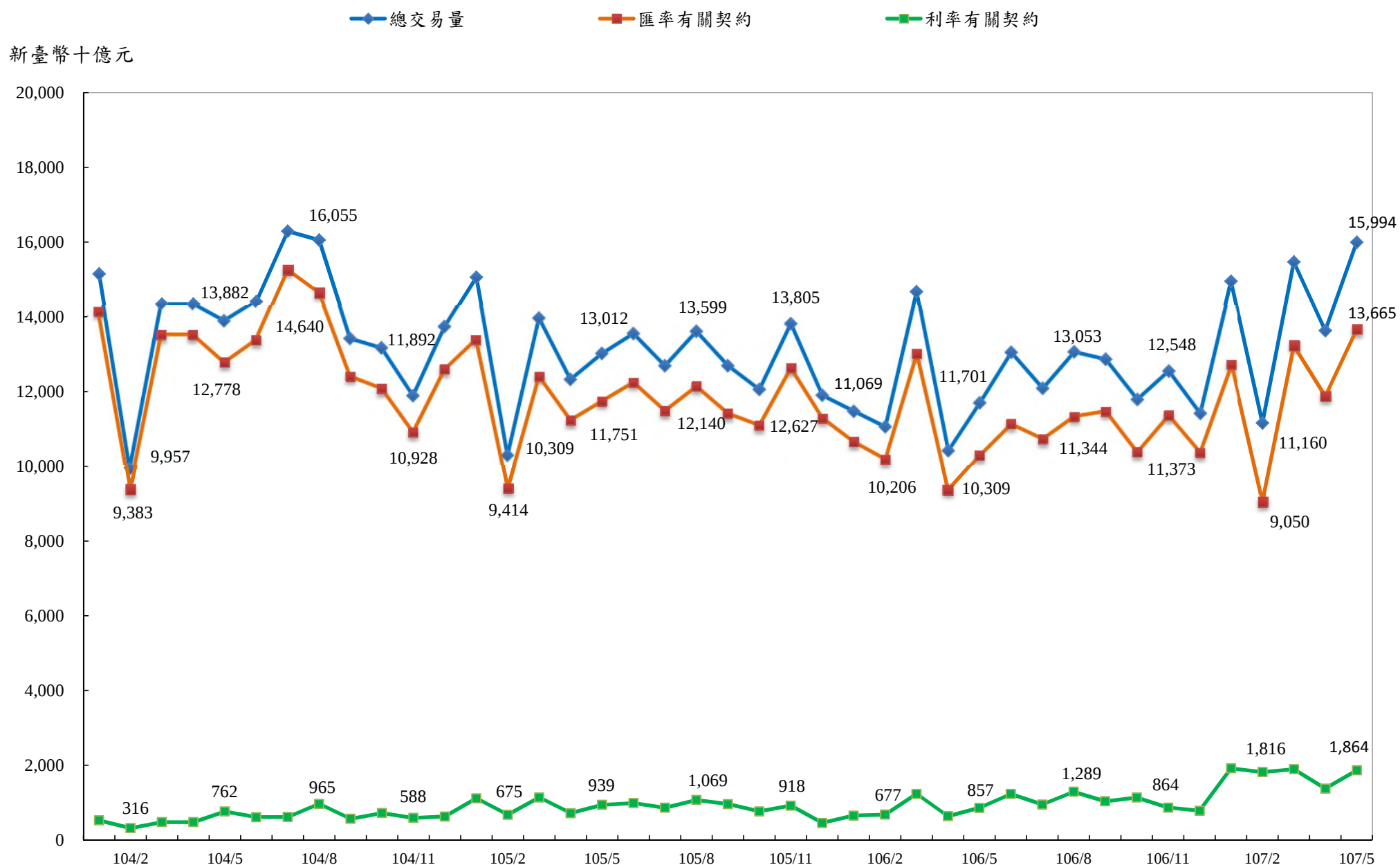
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

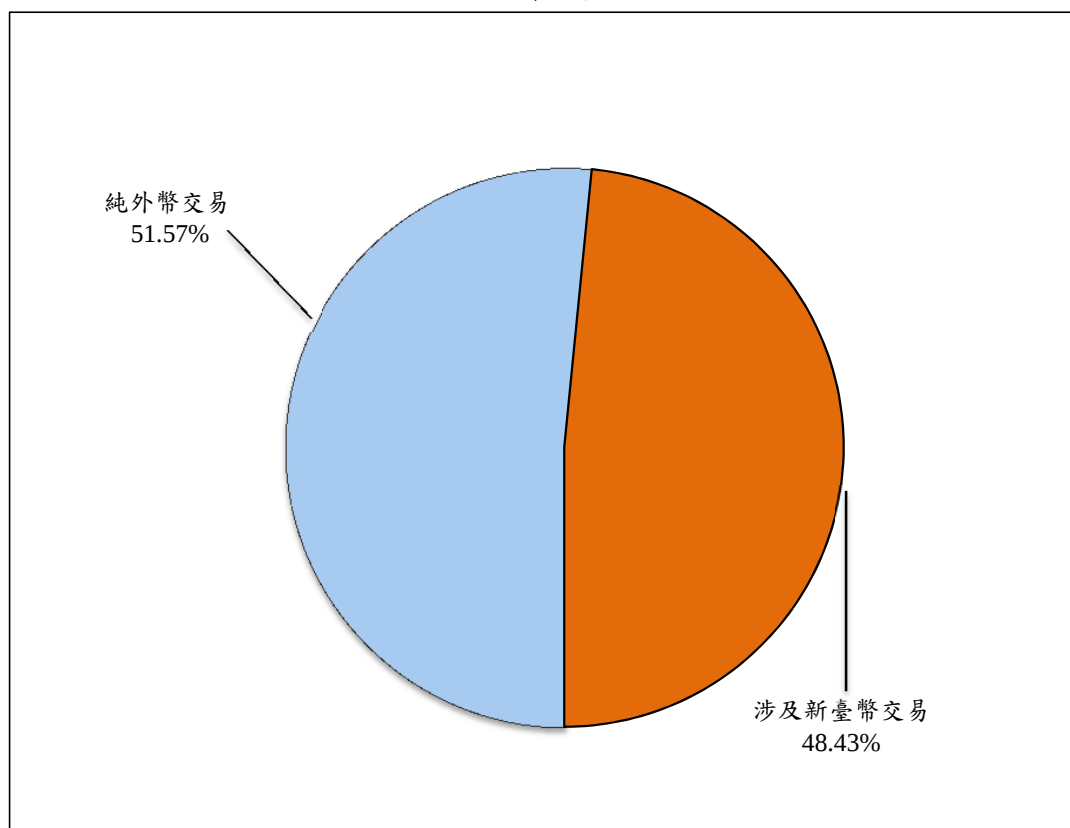
商 品 種 類	107年5月		107年4月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,863,831	11.65	1,374,412	10.08	489,419	35.61
(一)店頭市場(OTC)	628,511	3.93	497,108	3.65	131,403	26.43
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	589,013	3.68	450,587	3.31	138,426	30.72
3. 買入選擇權(Bought Options)	11,789	0.08	164	-	11,625	7,088.41
4. 賣出選擇權(Sold Options)	27,709	0.17	46,357	0.34	-18,648	-40.23
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,235,320	7.72	877,304	6.43	358,016	40.81
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	586,156	3.66	463,155	3.40	123,001	26.56
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	648,744	4.06	413,937	3.03	234,807	56.73
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	420	-	212	-	208	98.11
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	13,665,253	85.44	11,874,360	87.13	1,790,893	15.08
(一)店頭市場(OTC)	13,567,970	84.83	11,744,574	86.18	1,823,396	15.53
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,518,435	9.49	1,284,011	9.42	234,424	18.26
2. 換匯(Fx Swaps)	11,193,746	69.99	9,675,534	71.00	1,518,212	15.69
3. 換匯換利(Currency Swaps)	158,657	0.99	171,866	1.26	-13,209	-7.69
4. 買入選擇權(Bought Options)	352,536	2.20	314,880	2.31	37,656	11.96
5. 賣出選擇權(Sold Options)	344,596	2.16	298,283	2.19	46,313	15.53
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	97,283	0.61	129,786	0.95	-32,503	-25.04
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	41,441	0.26	53,420	0.39	-11,979	-22.42
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	38,566	0.24	52,132	0.38	-13,566	-26.02
3. 買入選擇權(Bought Options)	10,148	0.06	13,686	0.10	-3,538	-25.85
4. 賣出選擇權(Sold Options)	7,128	0.05	10,548	0.08	-3,420	-32.42
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	441,846	2.76	359,211	2.64	82,635	23.00
(一)店頭市場(OTC)	1,701	0.01	2,179	0.02	-478	-21.94
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	440,145	2.75	357,032	2.62	83,113	23.28
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	16,255	0.10	14,272	0.10	1,983	13.89
(一)店頭市場(OTC)	10,037	0.06	9,309	0.07	728	7.82
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,218	0.04	4,963	0.03	1,255	25.29
小 計(一至四)	15,987,185	99.95	13,622,255	99.95	2,364,930	17.36
五、信用有關契約(Credit Contracts)	6,998	0.05	6,567	0.05	431	6.56
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	6,998	0.05	6,567	0.05	431	6.56
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	15,994,183	100.00	13,628,822	100.00	2,365,361	17.36

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5月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

