

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2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)	160,755	1,654,969	1,815,724	16.27
(一)店頭市場(OTC)	160,221	339,443	499,664	4.48
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	534	1,315,526	1,316,060	11.79
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	4,648,050	4,402,388	9,050,438	81.10
(一)店頭市場(OTC)	4,648,050	4,374,684	9,022,734	80.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	27,704	27,704	0.25
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	270,595	11,929	282,524	2.53
(一)店頭市場(OTC)	149	2,204	2,353	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	270,446	9,725	280,171	2.51
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	440	6,539	6,979	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	3,763	3,763	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	440	2,776	3,216	0.03
小 計(一至四)	5,079,840	6,075,825	11,155,665	99.96
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	4,618	4,618	0.04
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,079,840	6,080,443	11,160,283	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2月	金 額	5,079,840	6,080,443	11,160,283
	比 重	45.52	54.48	100.00
107年1月	金 額	7,862,214	7,090,618	14,952,832
	比 重	52.58	47.42	100.00
比較增減	差 額	-2,782,374	-1,010,175	-3,792,549
	變動率	-35.39	-14.25	-25.36

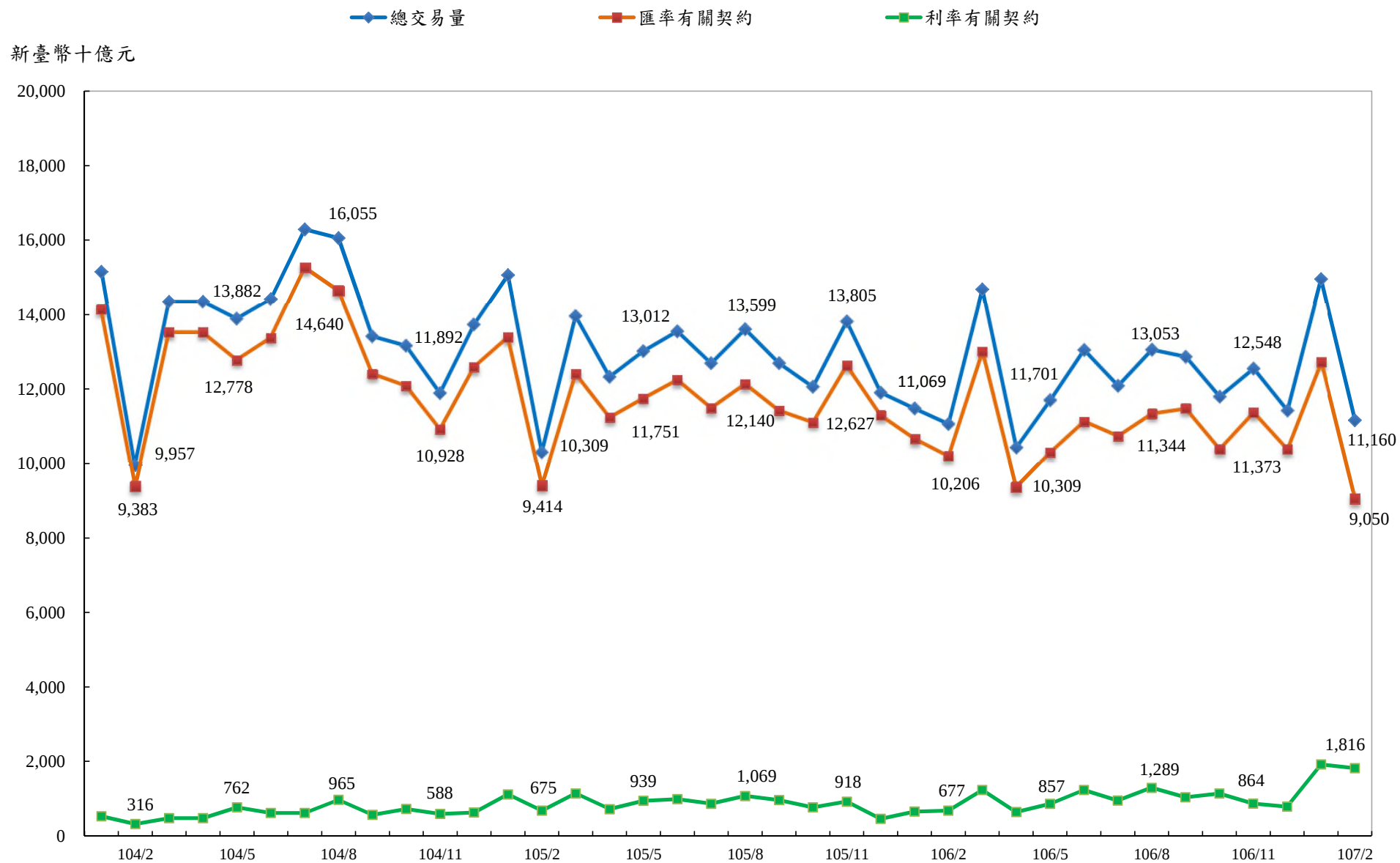
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

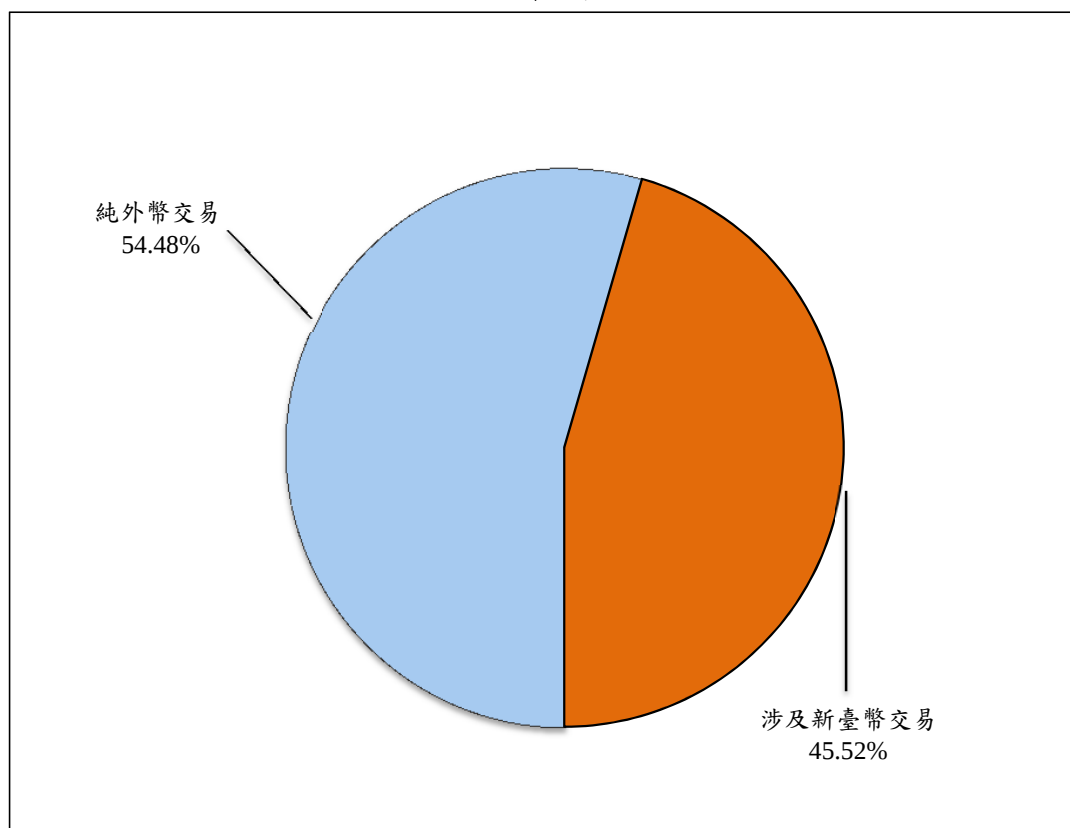
商 品 種 類	107年2月		107年1月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,815,724	16.27	1,915,917	12.81	-100,193	-5.23
(一)店頭市場(OTC)	499,664	4.48	1,008,892	6.75	-509,228	-50.47
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	335,857	3.01	821,995	5.50	-486,138	-59.14
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,963	0.05	1,159	0.01	3,804	328.21
4. 賣出選擇權(Sold Options)	158,844	1.42	185,738	1.24	-26,894	-14.48
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,316,060	11.79	907,025	6.06	409,035	45.10
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	660,072	5.91	444,634	2.97	215,438	48.45
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	655,366	5.87	461,716	3.09	193,650	41.94
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	408	-	-408	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	622	0.01	267	-	355	132.96
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	9,050,438	81.10	12,723,285	85.09	-3,672,847	-28.87
(一)店頭市場(OTC)	9,022,734	80.85	12,658,236	84.65	-3,635,502	-28.72
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,046,998	9.38	1,451,264	9.71	-404,266	-27.86
2. 換匯(Fx Swaps)	7,432,828	66.60	10,343,655	69.17	-2,910,827	-28.14
3. 換匯換利(Currency Swaps)	64,225	0.58	218,546	1.46	-154,321	-70.61
4. 買入選擇權(Bought Options)	241,848	2.17	322,015	2.15	-80,167	-24.90
5. 賣出選擇權(Sold Options)	236,835	2.12	322,756	2.16	-85,921	-26.62
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	27,704	0.25	65,049	0.44	-37,345	-57.41
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	11,761	0.11	20,411	0.14	-8,650	-42.38
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	13,021	0.12	23,202	0.15	-10,181	-43.88
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,392	0.01	11,538	0.08	-10,146	-87.94
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,530	0.01	9,898	0.07	-8,368	-84.54
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	282,524	2.53	298,819	2.00	-16,295	-5.45
(一)店頭市場(OTC)	2,353	0.02	1,548	0.01	805	52.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	280,171	2.51	297,271	1.99	-17,100	-5.75
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	6,979	0.06	12,625	0.09	-5,646	-44.72
(一)店頭市場(OTC)	3,763	0.03	7,301	0.05	-3,538	-48.46
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,216	0.03	5,324	0.04	-2,108	-39.59
小 計(一至四)	11,155,665	99.96	14,950,646	99.99	-3,794,981	-25.38
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,618	0.04	2,186	0.01	2,432	111.25
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	4,618	0.04	2,186	0.01	2,432	111.25
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	11,160,283	100.00	14,952,832	100.00	-3,792,549	-25.36

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2月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

