

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表
商 品 種 類 別

105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)	327, 722	611, 133	938, 855	7. 20
(一)店頭市場(OTC)	327, 722	153, 965	481, 687	3. 70
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	457, 168	457, 168	3. 50
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5, 349, 813	6, 431, 845	11, 781, 658	90. 33
(一)店頭市場(OTC)	5, 349, 813	6, 305, 483	11, 655, 296	89. 36
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	126, 362	126, 362	0. 97
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	295, 464	10, 160	305, 624	2. 34
(一)店頭市場(OTC)	139	469	608	-
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	295, 325	9, 691	305, 016	2. 34
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	793	14, 238	15, 031	0. 12
(一)店頭市場(OTC)	-	8, 025	8, 025	0. 06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	793	6, 213	7, 006	0. 06
小 計(一至四)	5, 973, 792	7, 067, 376	13, 041, 168	99. 99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1, 861	1, 861	0. 01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5, 973, 792	7, 069, 237	13, 043, 029	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
105年5月	金 額	5, 973, 792	7, 069, 237	13, 043, 029
	比 重	45. 80	54. 20	100. 00
105年4月	金 額	5, 919, 269	6, 406, 334	12, 325, 603
	比 重	48. 02	51. 98	100. 00
比較增減	差 額	54, 523	662, 903	717, 426
	變動率	0. 92	10. 35	5. 82

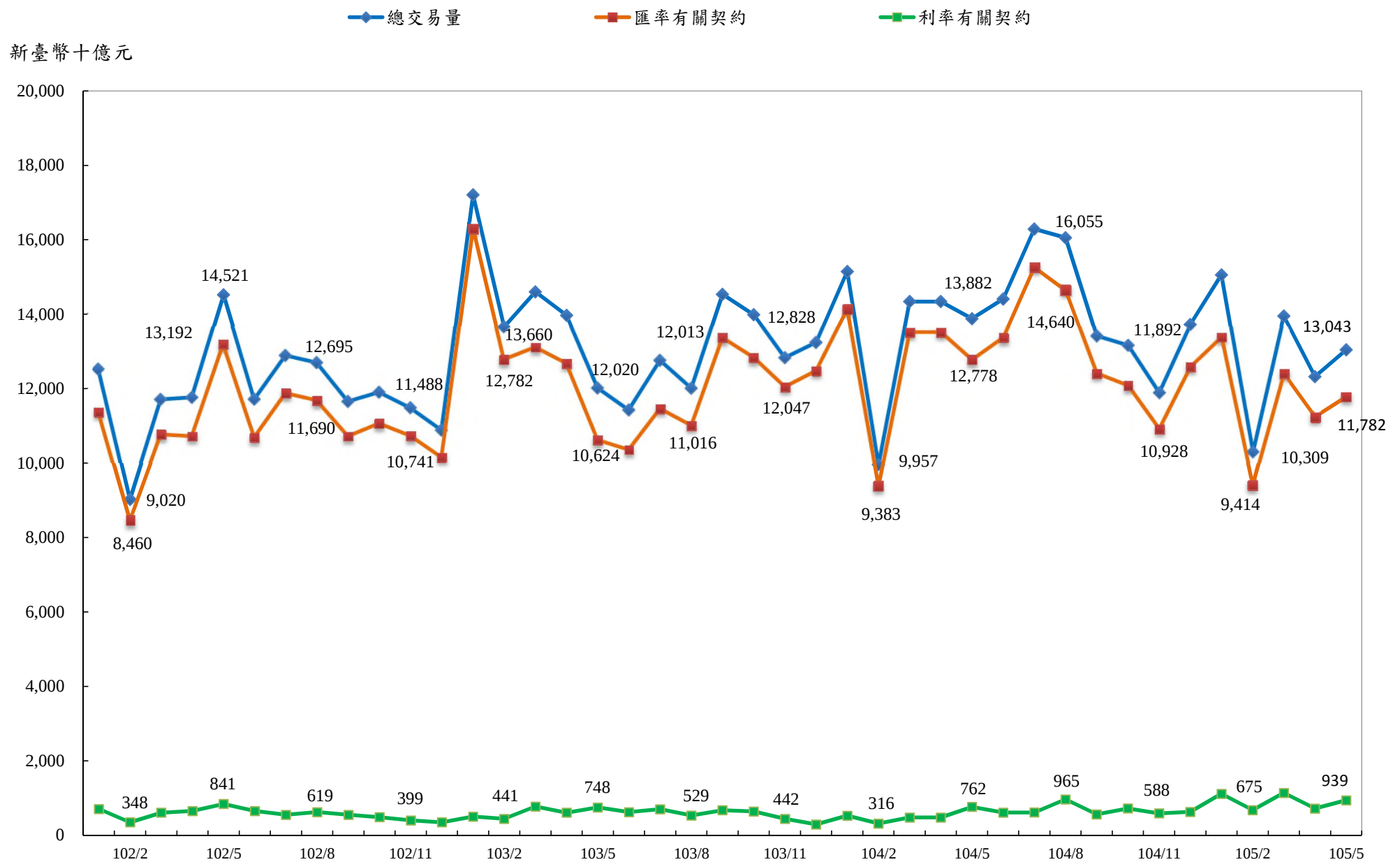
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

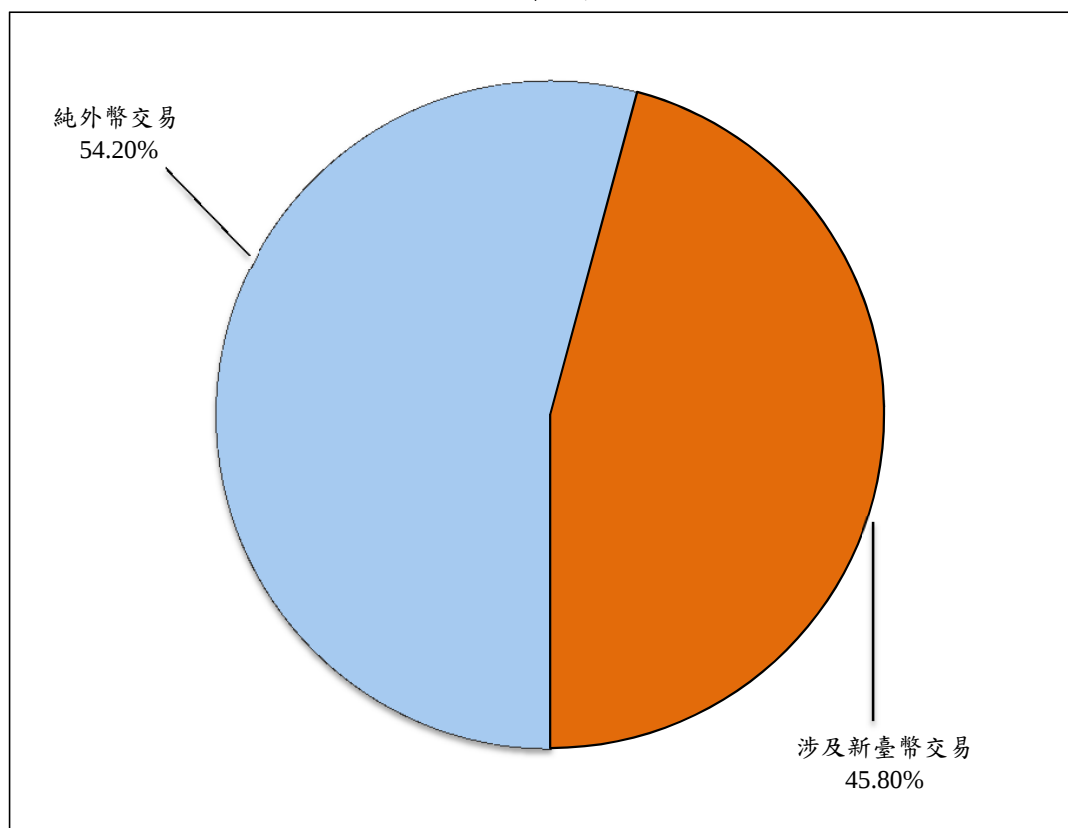
商 品 種 類	105年5月		105年4月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	938,855	7.20	716,530	5.82	222,325	31.03
(一)店頭市場(OTC)	481,687	3.70	370,474	3.01	111,213	30.02
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	465,017	3.57	337,512	2.74	127,505	37.78
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,867	0.04	4,426	0.04	441	9.96
4. 賣出選擇權(Sold Options)	11,803	0.09	28,536	0.23	-16,733	-58.64
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	457,168	3.50	346,056	2.81	111,112	32.11
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	216,870	1.66	176,463	1.43	40,407	22.90
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	240,298	1.84	168,434	1.37	71,864	42.67
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	1,159	0.01	-1,159	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,781,658	90.33	11,245,394	91.23	536,264	4.77
(一)店頭市場(OTC)	11,655,296	89.36	11,203,104	90.89	452,192	4.04
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,265,362	9.70	1,261,613	10.24	3,749	0.30
2. 換匯(Fx Swaps)	9,280,347	71.15	8,994,265	72.97	286,082	3.18
3. 換匯換利(Currency Swaps)	147,851	1.13	177,804	1.44	-29,953	-16.85
4. 買入選擇權(Bought Options)	484,654	3.72	386,986	3.14	97,668	25.24
5. 賣出選擇權(Sold Options)	477,082	3.66	382,436	3.10	94,646	24.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	126,362	0.97	42,290	0.34	84,072	198.80
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	63,337	0.49	20,899	0.17	42,438	203.06
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	63,025	0.48	21,391	0.17	41,634	194.63
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	305,624	2.34	327,590	2.66	-21,966	-6.71
(一)店頭市場(OTC)	608	-	253	-	355	140.32
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	305,016	2.34	327,337	2.66	-22,321	-6.82
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	15,031	0.12	33,298	0.27	-18,267	-54.86
(一)店頭市場(OTC)	8,025	0.06	9,906	0.08	-1,881	-18.99
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,006	0.06	23,392	0.19	-16,386	-70.05
小 計(一至四)	13,041,168	99.99	12,322,812	99.98	718,356	5.83
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,861	0.01	2,791	0.02	-930	-33.32
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,861	0.01	2,791	0.02	-930	-33.32
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	13,043,029	100.00	12,325,603	100.00	717,426	5.82

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2 105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

