

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6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)	349,325	1,001,972	1,351,297	9.18
(一)店頭市場(OTC)	346,153	205,399	551,552	3.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,172	796,573	799,745	5.43
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	6,294,113	6,674,260	12,968,373	88.06
(一)店頭市場(OTC)	6,294,113	6,580,237	12,874,350	87.42
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	94,023	94,023	0.64
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	369,913	13,826	383,739	2.61
(一)店頭市場(OTC)	-	806	806	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	369,913	13,020	382,933	2.60
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	722	14,308	15,030	0.10
(一)店頭市場(OTC)	-	12,028	12,028	0.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	722	2,280	3,002	0.02
小 計(一至四)	7,014,073	7,704,366	14,718,439	99.95
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	7,883	7,883	0.05
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,014,073	7,712,249	14,726,322	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6月	金 額	7,014,073	7,712,249	14,726,322
	比 重	47.63	52.37	100.00
107年5月	金 額	7,746,113	8,248,070	15,994,183
	比 重	48.43	51.57	100.00
比較增減	差 額	-732,040	-535,821	-1,267,861
	變動率	-9.45	-6.50	-7.93

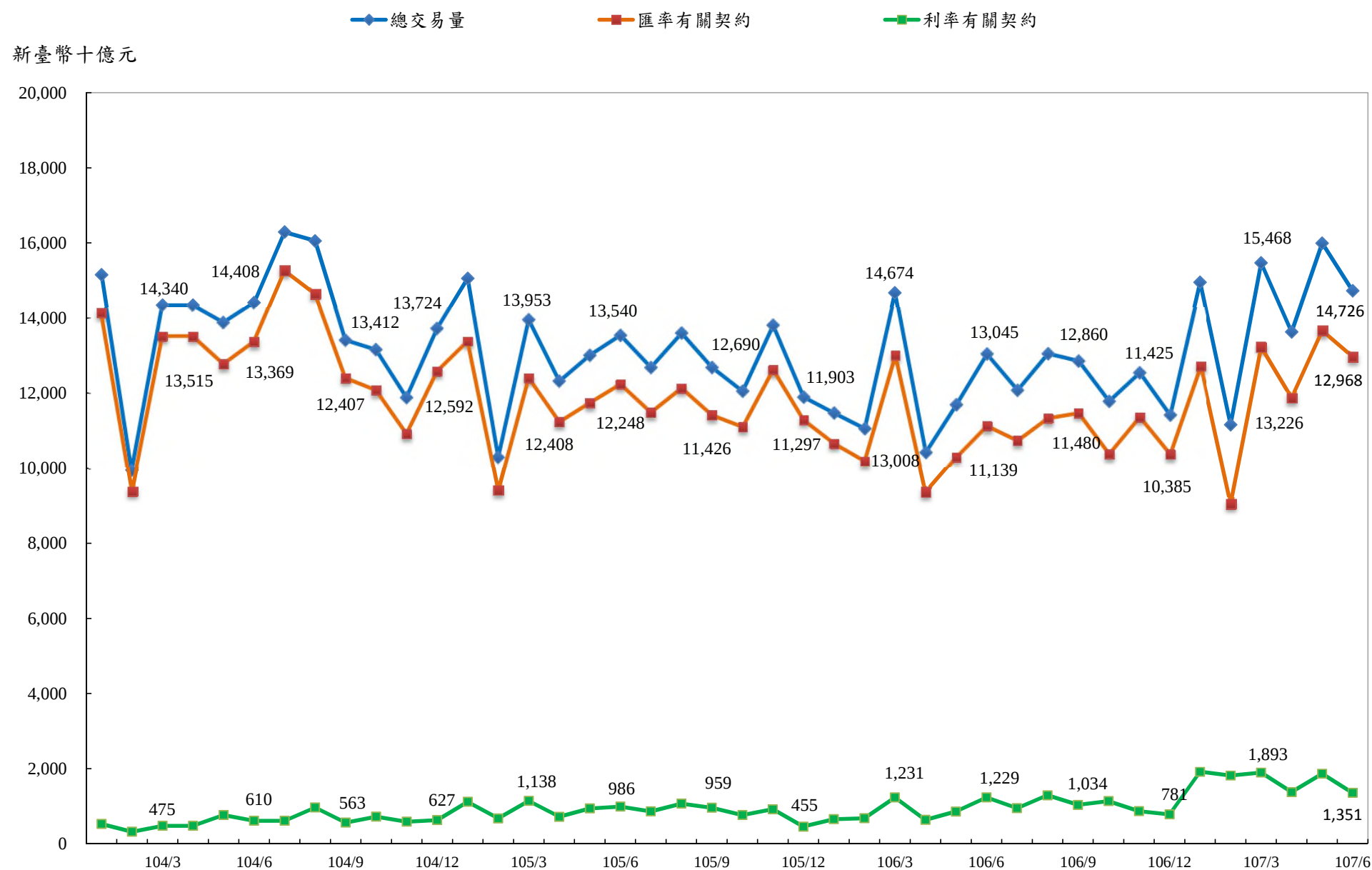
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	107年6月		107年5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)	1,351,297	9.18	1,863,831	11.65	-512,534	-27.50
(一)店頭市場(OTC)	551,552	3.75	628,511	3.93	-76,959	-12.24
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	543,620	3.69	589,013	3.68	-45,393	-7.71
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,458	0.03	11,789	0.08	-8,331	-70.67
4. 賣出選擇權(Sold Options)	4,474	0.03	27,709	0.17	-23,235	-83.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	799,745	5.43	1,235,320	7.72	-435,575	-35.26
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	386,338	2.62	586,156	3.66	-199,818	-34.09
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	413,407	2.81	648,744	4.06	-235,337	-36.28
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	420	-	-420	-100.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,968,373	88.06	13,665,253	85.44	-696,880	-5.10
(一)店頭市場(OTC)	12,874,350	87.42	13,567,970	84.83	-693,620	-5.11
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,515,872	10.29	1,518,435	9.49	-2,563	-0.17
2. 換匯(Fx Swaps)	10,607,209	72.03	11,193,746	69.99	-586,537	-5.24
3. 換匯換利(Currency Swaps)	66,053	0.45	158,657	0.99	-92,604	-58.37
4. 買入選擇權(Bought Options)	346,424	2.35	352,536	2.20	-6,112	-1.73
5. 賣出選擇權(Sold Options)	338,792	2.30	344,596	2.16	-5,804	-1.68
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	94,023	0.64	97,283	0.61	-3,260	-3.35
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	43,079	0.29	41,441	0.26	1,638	3.95
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	42,725	0.29	38,566	0.24	4,159	10.78
3. 買入選擇權(Bought Options)	4,892	0.04	10,148	0.06	-5,256	-51.79
4. 賣出選擇權(Sold Options)	3,327	0.02	7,128	0.05	-3,801	-53.32
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	383,739	2.61	441,846	2.76	-58,107	-13.15
(一)店頭市場(OTC)	806	0.01	1,701	0.01	-895	-52.62
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	382,933	2.60	440,145	2.75	-57,212	-13.00
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	15,030	0.10	16,255	0.10	-1,225	-7.54
(一)店頭市場(OTC)	12,028	0.08	10,037	0.06	1,991	19.84
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,002	0.02	6,218	0.04	-3,216	-51.72
小 計(一至四)	14,718,439	99.95	15,987,185	99.95	-1,268,746	-7.94
五、信用有關契約(Credit Contracts)	7,883	0.05	6,998	0.05	885	12.65
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	7,883	0.05	6,998	0.05	885	12.65
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	14,726,322	100.00	15,994,183	100.00	-1,267,861	-7.93

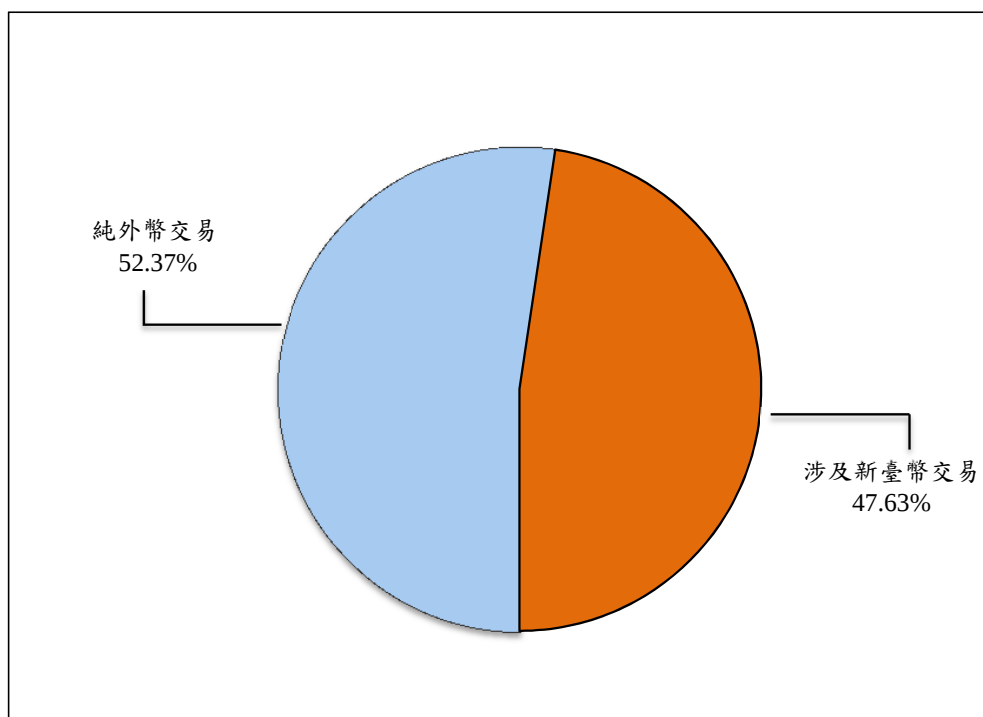
註：包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

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6月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

