

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表
商 品 種 類 別

108年4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			
	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)	416,948	916,441	1,333,389	9.67
（一）店頭市場(OTC)	416,948	135,491	552,439	4.01
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	780,950	780,950	5.66
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,217,133	6,085,080	12,302,213	89.21
（一）店頭市場(OTC)	6,217,133	5,992,659	12,209,792	88.54
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	92,421	92,421	0.67
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	129,400	7,195	136,595	0.99
（一）店頭市場(OTC)	-	494	494	0.00
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	129,400	6,701	136,101	0.99
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	589	17,192	17,781	0.13
（一）店頭市場(OTC)	-	8,360	8,360	0.06
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	589	8,832	9,421	0.07
小 計(一至四)	6,764,070	7,025,908	13,789,978	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	499	499	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,764,070	7,026,407	13,790,477	100.00

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。

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
108年4月	金 額	6,764,070	7,026,407	13,790,477
	比 重	49.05	50.95	100.00
108年3月	金 額	6,681,666	8,125,534	14,807,200
	比 重	45.12	54.88	100.00
比較增減	差 額	82,404	-1,099,127	-1,016,723
	變動率	1.23	-13.53	-6.87

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

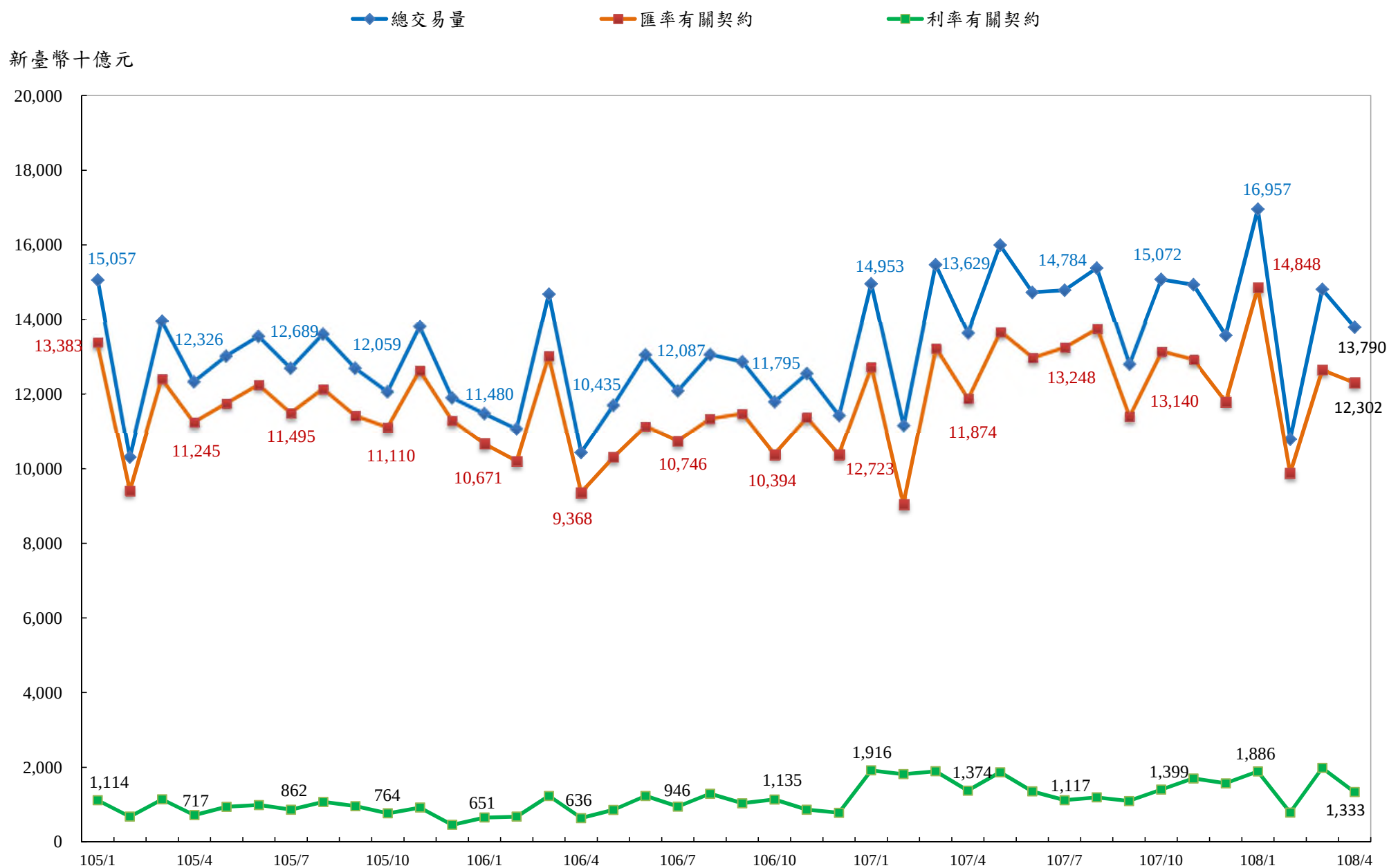
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	108年4月		108年3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)	1,333,389	9.67	1,980,846	13.38	-647,457	-32.69
(一)店頭市場(OTC)	552,439	4.01	741,953	5.01	-189,514	-25.54
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	527,333	3.82	728,352	4.92	-201,019	-27.60
3. 買入選擇權(Bought Options)	14,742	0.11	8,285	0.06	6,457	77.94
4. 賣出選擇權(Sold Options)	10,364	0.08	5,316	0.03	5,048	94.96
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	780,950	5.66	1,238,893	8.37	-457,943	-36.96
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	389,893	2.82	638,980	4.32	-249,087	-38.98
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	388,585	2.82	598,989	4.05	-210,404	-35.13
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,236	0.01	462	0.00	774	167.53
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,236	0.01	462	0.00	774	167.53
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,302,213	89.21	12,647,589	85.41	-345,376	-2.73
(一)店頭市場(OTC)	12,209,792	88.54	12,525,998	84.59	-316,206	-2.52
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,553,401	11.27	1,516,835	10.24	36,566	2.41
2. 換匯(Fx Swaps)	10,012,458	72.60	10,288,369	69.48	-275,911	-2.68
3. 換匯換利(Currency Swaps)	85,183	0.62	121,014	0.82	-35,831	-29.61
4. 買入選擇權(Bought Options)	292,759	2.12	306,860	2.07	-14,101	-4.60
5. 賣出選擇權(Sold Options)	265,991	1.93	292,920	1.98	-26,929	-9.19
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	92,421	0.67	121,591	0.82	-29,170	-23.99
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	34,357	0.25	52,428	0.35	-18,071	-34.47
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	37,003	0.27	50,668	0.34	-13,665	-26.97
3. 買入選擇權(Bought Options)	11,370	0.08	9,681	0.07	1,689	17.45
4. 賣出選擇權(Sold Options)	9,691	0.07	8,814	0.06	877	9.95
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	136,595	0.99	152,857	1.03	-16,262	-10.64
(一)店頭市場(OTC)	494	0.00	2,851	0.02	-2,357	-82.67
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	136,101	0.99	150,006	1.01	-13,905	-9.27
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	17,781	0.13	20,026	0.14	-2,245	-11.21
(一)店頭市場(OTC)	8,360	0.06	11,645	0.08	-3,285	-28.21
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	9,421	0.07	8,381	0.06	1,040	12.41
小 計(一至四)	13,789,978	100.00	14,801,318	99.96	-1,011,340	-6.83
五、信用有關契約(Credit Contracts)	499	0.00	5,882	0.04	-5,383	-91.52
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	499	0.00	5,882	0.04	-5,383	-91.52
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	13,790,477	100.00	14,807,200	100.00	-1,016,723	-6.87

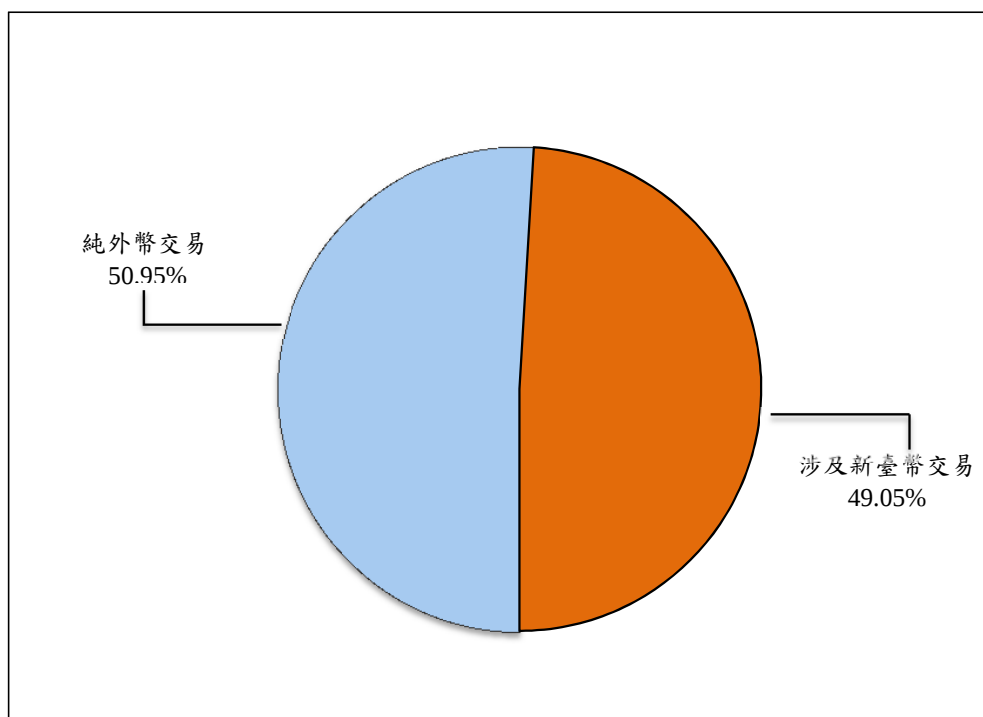
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

2. r為修正數。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量趨勢統計



附圖2 108年4月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

