

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3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)	474, 241	1, 506, 605	1, 980, 846	13. 38
(一)店頭市場(OTC)	474, 241	267, 712	741, 953	5. 01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1, 238, 893	1, 238, 893	8. 37
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6, 073, 693	6, 573, 896	12, 647, 589	85. 41
(一)店頭市場(OTC)	6, 073, 693	6, 452, 305	12, 525, 998	84. 59
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	121, 591	121, 591	0. 82
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	133, 119	19, 738	152, 857	1. 03
(一)店頭市場(OTC)	2, 479	372	2, 851	0. 02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	130, 640	19, 366	150, 006	1. 01
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	613	19, 413	20, 026	0. 14
(一)店頭市場(OTC)	-	11, 645	11, 645	0. 08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	613	7, 768	8, 381	0. 06
小 計(一至四)	6, 681, 666	8, 119, 652	14, 801, 318	99. 96
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	5, 882	5, 882	0. 04
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6, 681, 666	8, 125, 534	14, 807, 200	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3月	金 額	6, 681, 666	8, 125, 534	14, 807, 200
	比 重	45. 12	54. 88	100. 00
108年2月	金 額	5, 347, 959	r 5, 443, 305	r 10, 791, 264
	比 重	49. 56	50. 44	100. 00
比較增減	差 額	1, 333, 707	2, 682, 229	4, 015, 936
	變動率	24. 94	49. 28	37. 21

註：r為修正數。

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

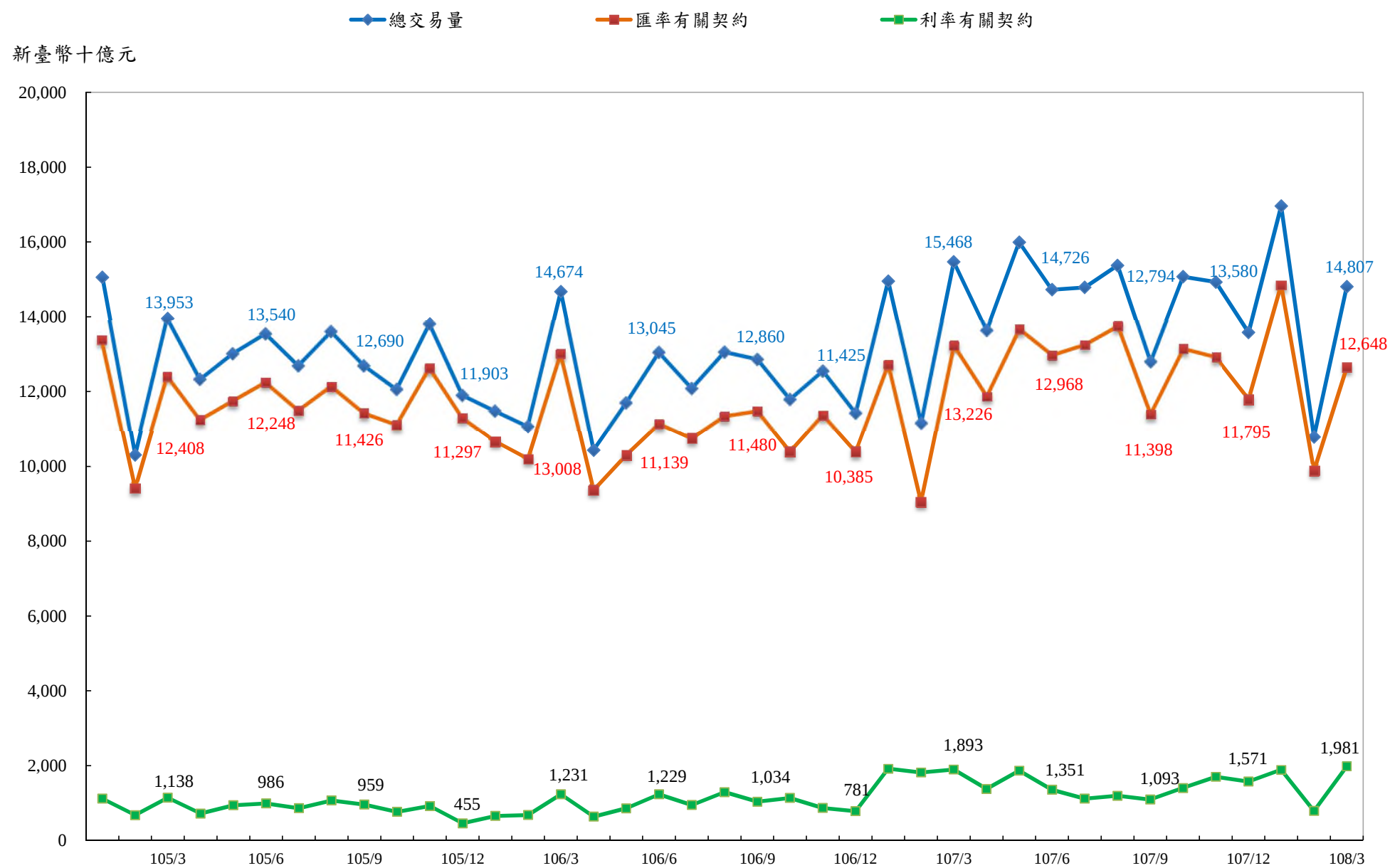
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	108年3月		108年2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)	1,980,846	13.38	786,566	7.29	1,194,280	151.83
(一)店頭市場(OTC)	741,953	5.01	431,818	4.00	310,135	71.82
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	728,352	4.92	424,111	3.93	304,241	71.74
3. 買入選擇權(Bought Options)	8,285	0.06	6,228	0.06	2,057	33.03
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,316	0.03	1,479	0.01	3,837	259.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,238,893	8.37	354,748	3.29	884,145	249.23
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	638,980	4.32	186,270	1.73	452,710	243.04
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	598,989	4.05	167,616	1.55	431,373	257.36
3. 買入選擇權(Bought Options)	462	0.00	-	-	462	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	462	0.00	862	0.01	-400	-46.40
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,647,589	85.41	r 9,881,959	91.57	2,765,630	27.99
(一)店頭市場(OTC)	12,525,998	84.59	r 9,813,031	90.93	2,712,967	27.65
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,516,835	10.24	r 1,189,002	11.02	327,833	27.57
2. 換匯(Fx Swaps)	10,288,369	69.48	8,055,492	74.65	2,232,877	27.72
3. 換匯換利(Currency Swaps)	121,014	0.82	101,401	0.94	19,613	19.34
4. 買入選擇權(Bought Options)	306,860	2.07	237,847	2.20	69,013	29.02
5. 賣出選擇權(Sold Options)	292,920	1.98	229,289	2.12	63,631	27.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	121,591	0.82	68,928	0.64	52,663	76.40
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	52,428	0.35	26,211	0.24	26,217	100.02
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	50,668	0.34	24,338	0.23	26,330	108.18
3. 買入選擇權(Bought Options)	9,681	0.07	9,942	0.09	-261	-2.63
4. 賣出選擇權(Sold Options)	8,814	0.06	8,437	0.08	377	4.47
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	152,857	1.03	108,755	1.01	44,102	40.55
(一)店頭市場(OTC)	2,851	0.02	948	0.01	1,903	200.74
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	150,006	1.01	107,807	1.00	42,199	39.14
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	20,026	0.14	10,805	0.10	9,221	85.34
(一)店頭市場(OTC)	11,645	0.08	7,422	0.07	4,223	56.90
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	8,381	0.06	3,383	0.03	4,998	147.74
小 計(一至四)	14,801,318	99.96	r 10,788,085	99.97	4,013,233	37.20
五、信用有關契約(Credit Contracts)	5,882	0.04	3,179	0.03	2,703	85.03
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	5,882	0.04	3,179	0.03	2,703	85.03
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	14,807,200	100.00	r 10,791,264	100.00	4,015,936	37.21

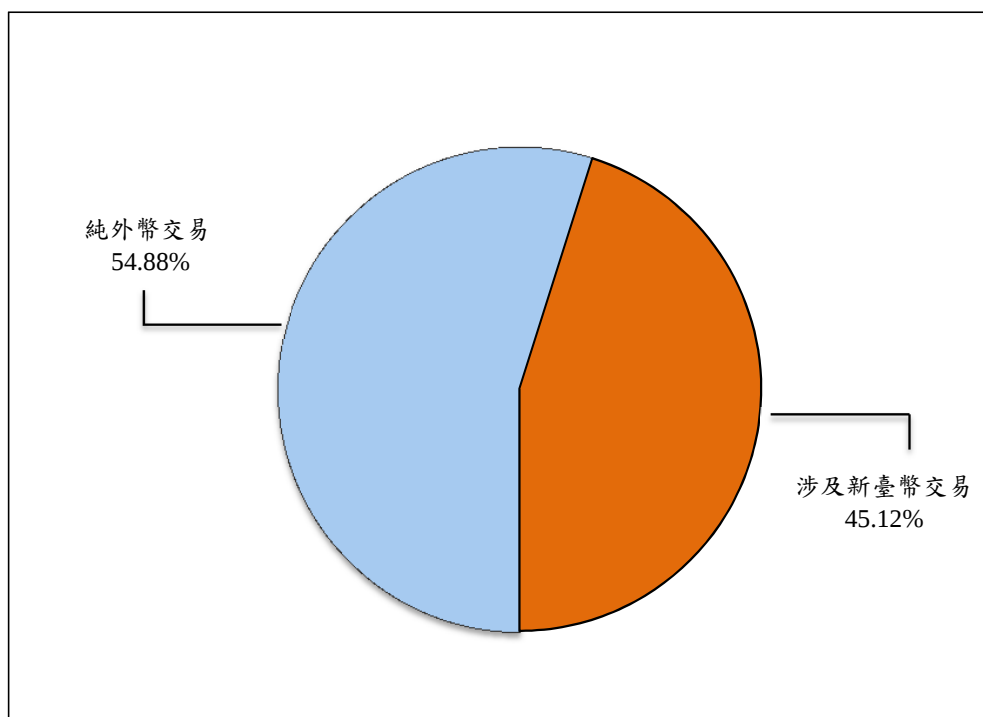
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

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3月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

