

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			
	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)	343,754	442,812	786,566	7.29
(一)店頭市場(OTC)	343,754	88,064	431,818	4.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	354,748	354,748	3.29
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,907,483	4,974,522	9,882,005	91.57
(一)店頭市場(OTC)	4,907,483	4,905,594	9,813,077	90.93
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	68,928	68,928	0.64
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	96,256	12,499	108,755	1.01
(一)店頭市場(OTC)	730	218	948	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	95,526	12,281	107,807	1.00
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	466	10,339	10,805	0.10
(一)店頭市場(OTC)	-	7,422	7,422	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	466	2,917	3,383	0.03
小 計(一至四)	5,347,959	5,440,172	10,788,131	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3,179	3,179	0.03
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,347,959	5,443,351	10,791,310	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2月	金 額	5,347,959	5,443,351	10,791,310
	比 重	49.56	50.44	100.00
108年1月	金 額	8,916,966	8,039,615	16,956,581
	比 重	52.59	47.41	100.00
比較增減	差 額	-3,569,007	-2,596,264	-6,165,271
	變動率	-40.02	-32.29	-36.36

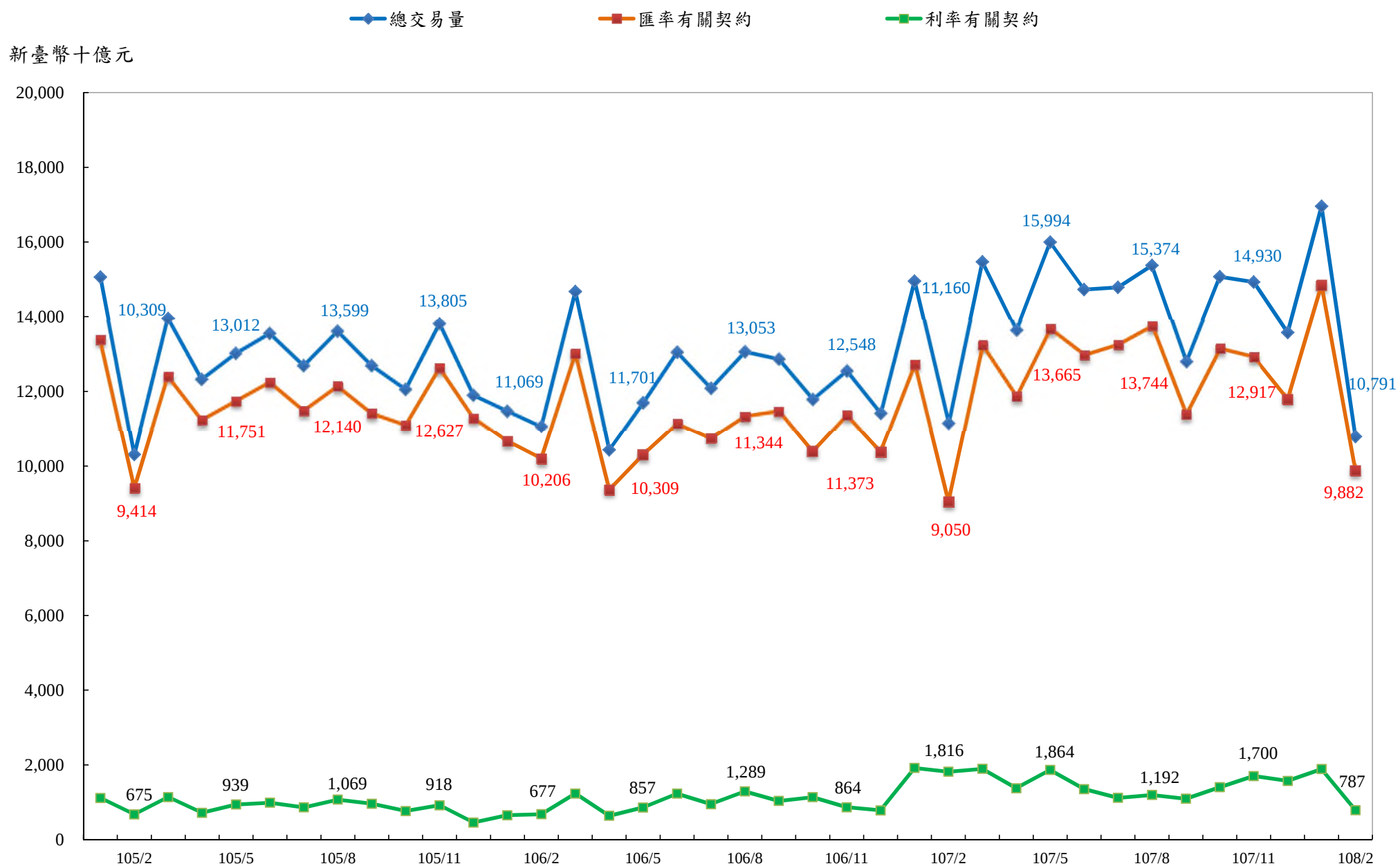
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	108年2月		108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)	786,566	7.29	1,886,282	11.12	-1,099,716	-58.30
(一)店頭市場(OTC)	431,818	4.00	888,618	5.24	-456,800	-51.41
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	424,111	3.93	882,552	5.21	-458,441	-51.94
3. 買入選擇權(Bought Options)	6,228	0.06	1,831	0.01	4,397	240.14
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,479	0.01	4,235	0.02	-2,756	-65.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	354,748	3.29	997,664	5.88	-642,916	-64.44
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	186,270	1.73	574,796	3.39	-388,526	-67.59
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	167,616	1.55	420,132	2.48	-252,516	-60.10
3. 買入選擇權(Bought Options)	-	-	1,814	0.01	-1,814	-100.00
4. 賣出選擇權(Sold Options)	862	0.01	922	0.00	-60	-6.51
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	9,882,005	91.57	14,848,223	87.57	-4,966,218	-33.45
(一)店頭市場(OTC)	9,813,077	90.93	14,752,048	87.00	-4,938,971	-33.48
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,189,048	11.02	1,844,173	10.88	-655,125	-35.52
2. 換匯(Fx Swaps)	8,055,492	74.65	11,997,040	70.75	-3,941,548	-32.85
3. 換匯換利(Currency Swaps)	101,401	0.94	230,710	1.36	-129,309	-56.05
4. 買入選擇權(Bought Options)	237,847	2.20	351,683	2.07	-113,836	-32.37
5. 賣出選擇權(Sold Options)	229,289	2.12	328,442	1.94	-99,153	-30.19
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	68,928	0.64	96,175	0.57	-27,247	-28.33
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	26,211	0.24	38,688	0.23	-12,477	-32.25
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	24,338	0.23	38,710	0.23	-14,372	-37.13
3. 買入選擇權(Bought Options)	9,942	0.09	11,140	0.07	-1,198	-10.75
4. 賣出選擇權(Sold Options)	8,437	0.08	7,637	0.04	800	10.48
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	108,755	1.01	202,611	1.19	-93,856	-46.32
(一)店頭市場(OTC)	948	0.01	4,079	0.02	-3,131	-76.76
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	107,807	1.00	198,532	1.17	-90,725	-45.70
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,805	0.10	16,838	0.10	-6,033	-35.83
(一)店頭市場(OTC)	7,422	0.07	13,175	0.08	-5,753	-43.67
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,383	0.03	3,663	0.02	-280	-7.64
小 計(一至四)	10,788,131	99.97	16,953,954	99.98	-6,165,823	-36.37
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,179	0.03	2,627	0.02	552	21.01
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	3,179	0.03	2,627	0.02	552	21.01
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	10,791,310	100.00	16,956,581	100.00	-6,165,271	-36.36

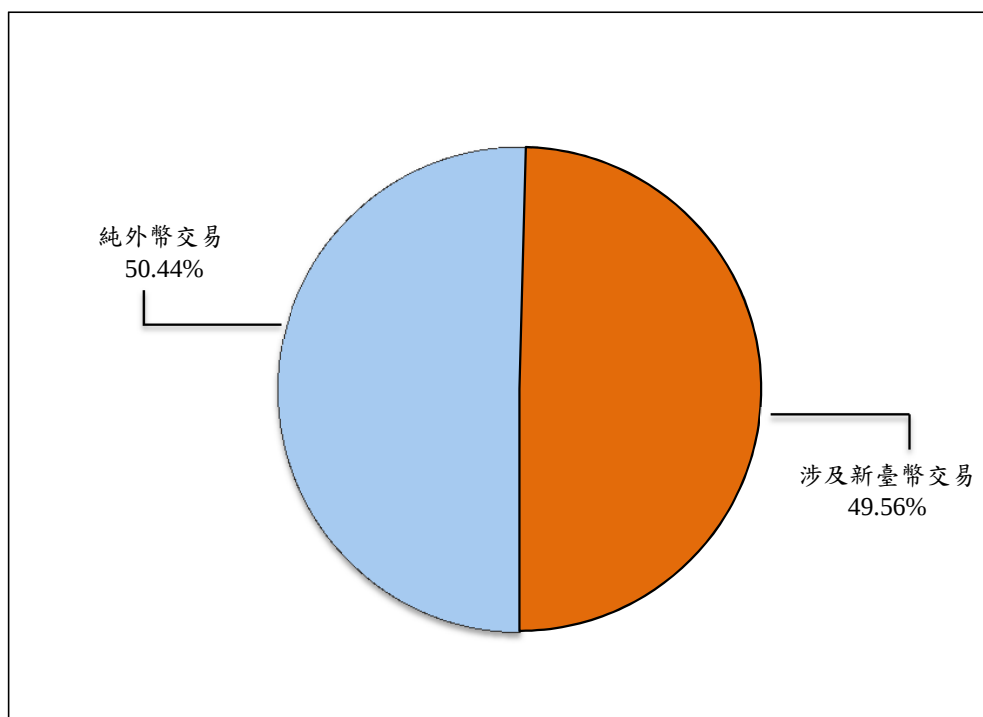
註：包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量趨勢統計



附圖2 108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

