

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1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)	608,760	1,277,522	1,886,282	11.12
(一)店頭市場(OTC)	608,760	279,858	888,618	5.24
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	997,664	997,664	5.88
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	8,123,378	6,724,845	14,848,223	87.57
(一)店頭市場(OTC)	8,123,378	6,628,670	14,752,048	87.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	96,175	96,175	0.57
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	184,146	18,465	202,611	1.19
(一)店頭市場(OTC)	3,652	427	4,079	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	180,494	18,038	198,532	1.17
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	682	16,156	16,838	0.10
(一)店頭市場(OTC)	-	13,175	13,175	0.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	682	2,981	3,663	0.02
小 計(一至四)	8,916,966	8,036,988	16,953,954	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,627	2,627	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	8,916,966	8,039,615	16,956,581	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1月	金 額	8,916,966	8,039,615	16,956,581
	比 重	52.59	47.41	100.00
107年12月	金 額	r 6,757,601	6,818,817	r 13,576,418
	比 重	r 49.77	r 50.23	100.00
比較增減	差 額	2,159,365	1,220,798	3,380,163
	變動率	31.95	17.90	24.90

註：r為修正數。

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

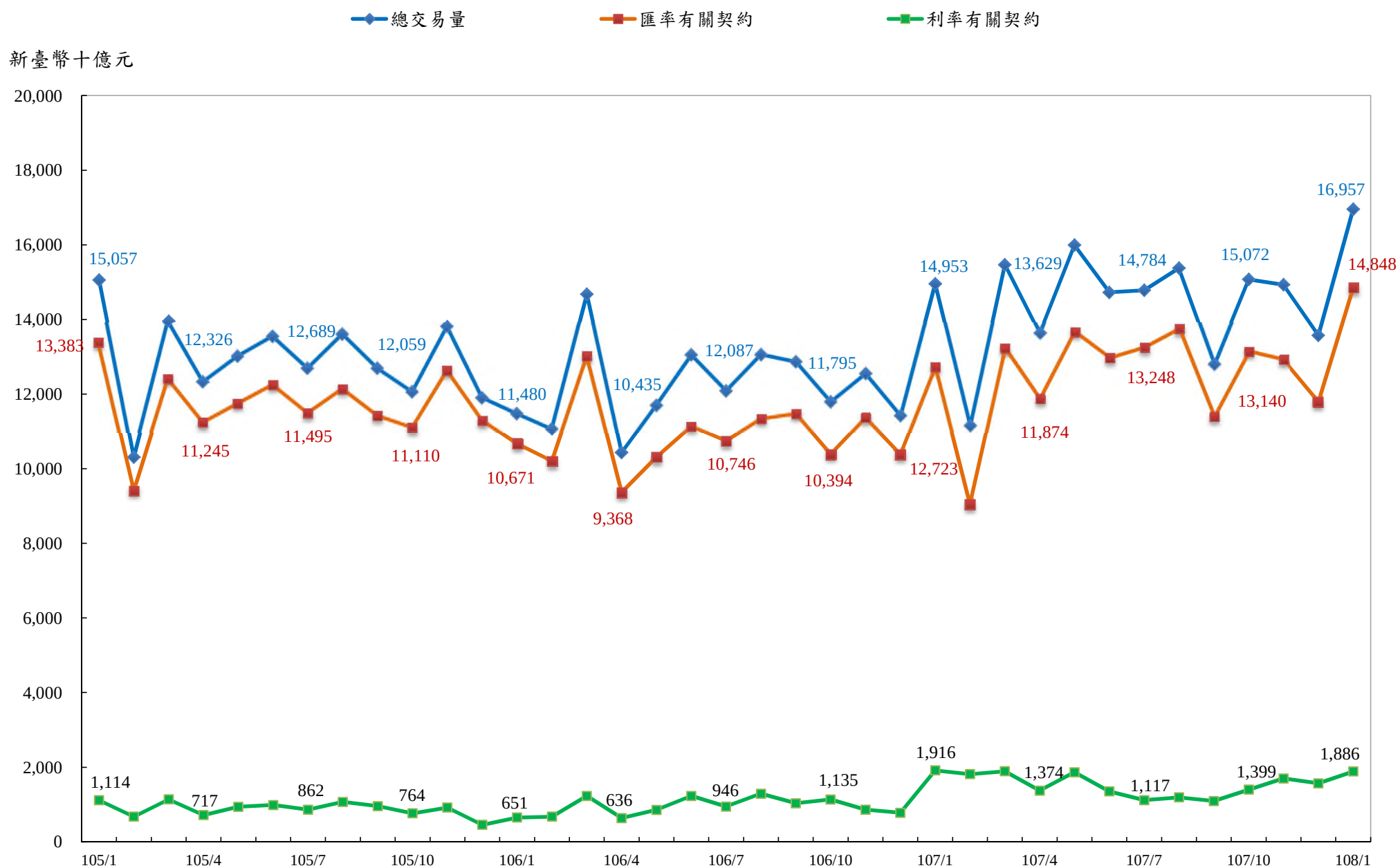
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	108年1月		107年12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)	1,886,282	11.12	r 1,568,111	11.55	318,171	20.29
(一)店頭市場(OTC)	888,618	5.24	r 515,731	3.80	372,887	72.30
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	3,200	0.02	-3,200	-100.00
2. 換利(IRS)	882,552	5.21	471,671	3.48	410,881	87.11
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,831	0.01	r 18,024	0.13	-16,193	-89.84
4. 賣出選擇權(Sold Options)	4,235	0.02	r 22,836	0.17	-18,601	-81.45
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	997,664	5.88	1,052,380	7.75	-54,716	-5.20
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	574,796	3.39	444,374	3.27	130,422	29.35
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	420,132	2.48	607,837	4.48	-187,705	-30.88
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,814	0.01	-	-	1,814	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	922	0.00	169	0.00	753	445.56
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	14,848,223	87.57	r 11,793,771	86.87	3,054,452	25.90
(一)店頭市場(OTC)	14,752,048	87.00	r 11,751,494	86.56	3,000,554	25.53
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,844,173	10.88	r 1,418,974	10.45	425,199	29.97
2. 換匯(Fx Swaps)	11,997,040	70.75	9,829,888	72.41	2,167,152	22.05
3. 換匯換利(Currency Swaps)	230,710	1.36	r 129,808	0.96	100,902	77.73
4. 買入選擇權(Bought Options)	351,683	2.07	r 189,014	1.39	162,669	86.06
5. 賣出選擇權(Sold Options)	328,442	1.94	r 183,810	1.35	144,632	78.69
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	96,175	0.57	42,277	0.31	53,898	127.49
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	38,688	0.23	18,256	0.13	20,432	111.92
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	38,710	0.23	17,389	0.12	21,321	122.61
3. 買入選擇權(Bought Options)	11,140	0.07	3,323	0.03	7,817	235.24
4. 賣出選擇權(Sold Options)	7,637	0.04	3,309	0.03	4,328	130.79
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	202,611	1.19	198,645	1.46	3,966	2.00
(一)店頭市場(OTC)	4,079	0.02	2,070	0.01	2,009	97.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	198,532	1.17	196,575	1.45	1,957	1.00
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	16,838	0.10	9,481	0.07	7,357	77.60
(一)店頭市場(OTC)	13,175	0.08	7,585	0.06	5,590	73.70
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,663	0.02	1,896	0.01	1,767	93.20
小 計(一至四)	16,953,954	99.98	r 13,570,008	99.95	3,383,946	24.94
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,627	0.02	6,410	0.05	-3,783	-59.02
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	2,627	0.02	6,410	0.05	-3,783	-59.02
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	16,956,581	100.00	r 13,576,418	100.00	3,380,163	24.90

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。

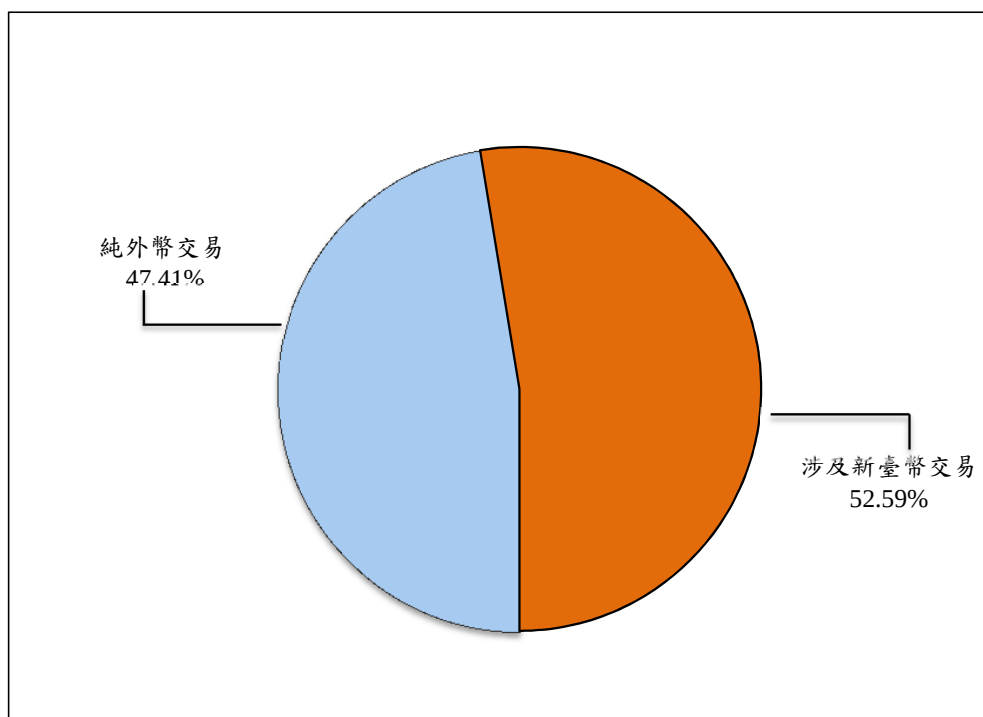
2. r為修正數。

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1月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

