

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9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)	386,302	773,192	1,159,494	8.45
(一)店頭市場(OTC)	386,302	201,020	587,322	4.28
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	572,172	572,172	4.17
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,888,630	6,382,808	12,271,438	89.42
(一)店頭市場(OTC)	5,888,630	6,333,548	12,222,178	89.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	49,260	49,260	0.36
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	256,657	8,534	265,191	1.93
(一)店頭市場(OTC)	65	1,743	1,808	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	256,592	6,791	263,383	1.92
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	2,771	23,668	26,439	0.19
(一)店頭市場(OTC)	-	6,542	6,542	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,771	17,126	19,897	0.14
小 計(一至四)	6,534,360	7,188,202	13,722,562	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,086	1,086	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,534,360	7,189,288	13,723,648	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9月	金 額	6,534,360	7,189,288	13,723,648
	比 重	47.61	52.39	100.00
108年8月	金 額	6,593,596	8,940,383	15,533,979
	比 重	42.45	57.55	100.00
比較增減	差 額	-59,236	-1,751,095	-1,810,331
	變動率	-0.90	-19.59	-11.65

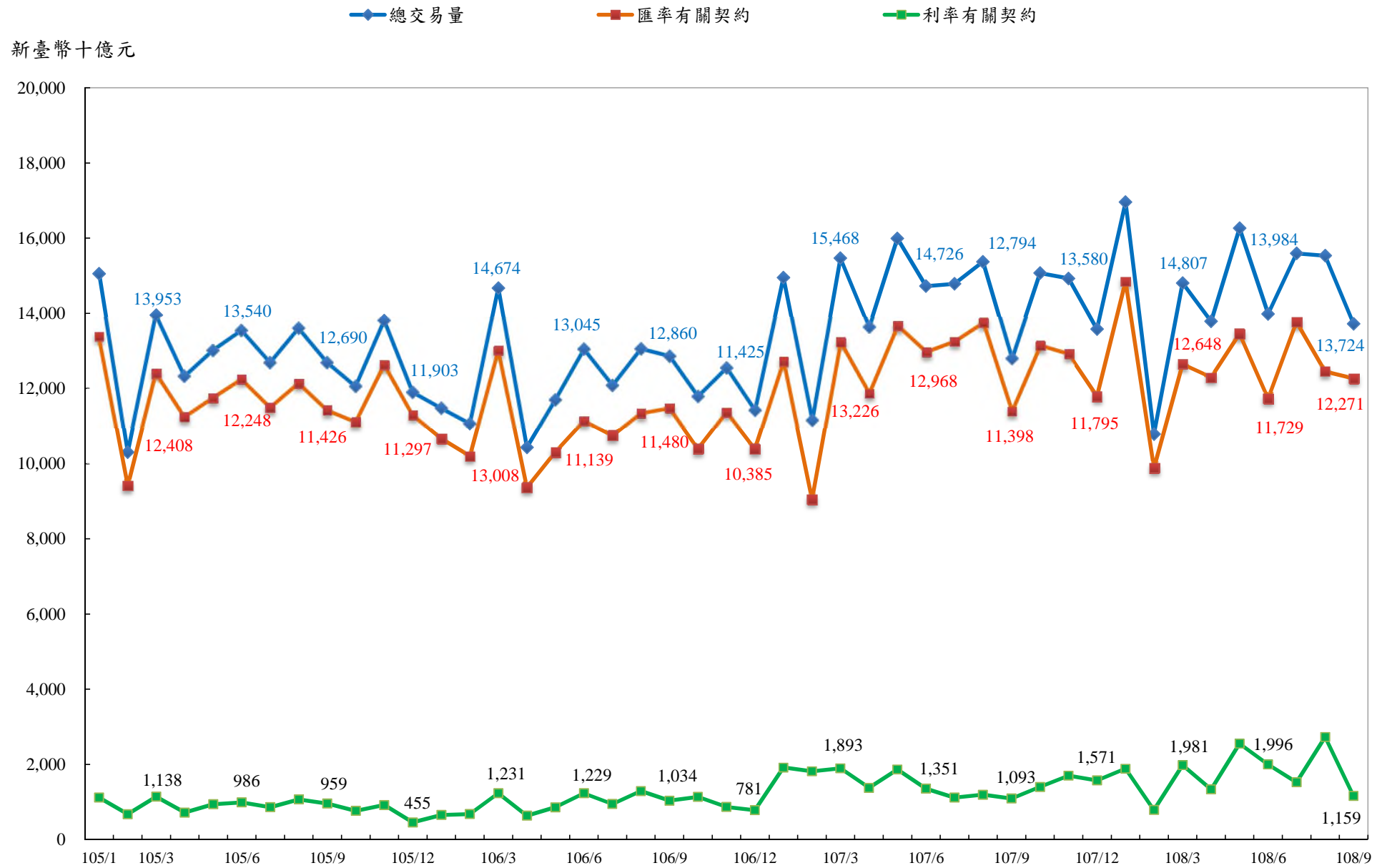
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	108年9月		108年8月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	1,159,494	8.45	2,726,357	17.55	-1,566,863	-57.47
(一)店頭市場(OTC)	587,322	4.28	739,858	4.76	-152,536	-20.62
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	532,746	3.88	711,039	4.58	-178,293	-25.07
3. 買入選擇權(Bought Options)	41,335	0.30	19,038	0.12	22,297	117.12
4. 賣出選擇權(Sold Options)	13,241	0.10	9,781	0.06	3,460	35.37
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	572,172	4.17	1,986,499	12.79	-1,414,327	-71.20
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	273,696	2.00	983,170	6.33	-709,474	-72.16
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	296,986	2.16	1,001,193	6.45	-704,207	-70.34
3. 買入選擇權(Bought Options)	947	0.01	1,571	0.01	-624	-39.72
4. 賣出選擇權(Sold Options)	543	0.00	565	0.00	-22	-3.89
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	12,271,438	89.42	12,453,079	80.16	-181,641	-1.46
(一)店頭市場(OTC)	12,222,178	89.06	12,384,035	79.72	-161,857	-1.31
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,648,338	12.01	1,599,787	10.30	48,551	3.03
2. 換匯(Fx Swaps)	9,953,790	72.53	10,065,107	64.79	-111,317	-1.11
3. 換匯換利(Currency Swaps)	113,619	0.83	74,793	0.48	38,826	51.91
4. 買入選擇權(Bought Options)	258,494	1.88	323,368	2.08	-64,874	-20.06
5. 賣出選擇權(Sold Options)	247,937	1.81	320,980	2.07	-73,043	-22.76
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	49,260	0.36	69,044	0.44	-19,784	-28.65
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	22,272	0.16	31,643	0.20	-9,371	-29.61
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	21,282	0.16	32,407	0.21	-11,125	-34.33
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,594	0.02	2,602	0.02	-8	-0.31
4. 賣出選擇權(Sold Options)	3,112	0.02	2,392	0.01	720	30.10
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	265,191	1.93	315,124	2.03	-49,933	-15.85
(一)店頭市場(OTC)	1,808	0.01	1,786	0.01	22	1.23
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	263,383	1.92	313,338	2.02	-49,955	-15.94
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	26,439	0.19	38,477	0.25	-12,038	-31.29
(一)店頭市場(OTC)	6,542	0.05	13,325	0.09	-6,783	-50.90
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	19,897	0.14	25,152	0.16	-5,255	-20.89
<b>小 計(一至四)</b>	13,722,562	99.99	15,533,037	99.99	-1,810,475	-11.66
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	1,086	0.01	942	0.01	144	15.29
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,086	0.01	942	0.01	144	15.29
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)	-	-	-	-	-	-
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	-	-	-	-	-	-
1. 遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2. 交換(Swaps)	-	-	-	-	-	-
3. 選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
<b>總 計</b>	13,723,648	100.00	15,533,979	100.00	-1,810,331	-11.65

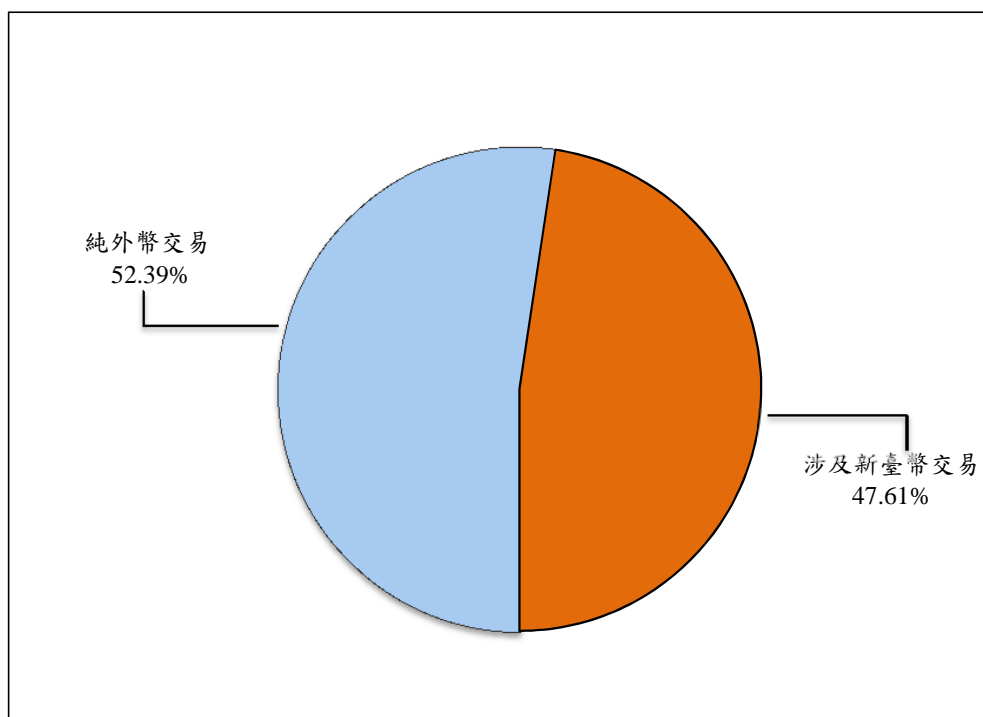
註：包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

# 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9月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

