

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表
商 品 種 類 別

107年11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 ¹			
	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)	529,601	1,170,611	1,700,212	11.39
（一）店頭市場(OTC)	529,601	266,916	796,517	5.34
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	903,695	903,695	6.05
二、匯率有關契約 ² (Foreign Exchange Transactions)	7,168,110	5,748,490	12,916,600	86.51
（一）店頭市場(OTC)	7,168,110	5,695,889	12,863,999	86.16
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	52,601	52,601	0.35
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	277,885	16,487	294,372	1.97
（一）店頭市場(OTC)	1,804	-	1,804	0.01
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	276,081	16,487	292,568	1.96
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	717	11,122	11,839	0.08
（一）店頭市場(OTC)	-	8,665	8,665	0.06
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	717	2,457	3,174	0.02
小 計(一至四)	7,976,313	6,946,710	14,923,023	99.95
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	7,469	7,469	0.05
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,976,313	6,954,179	14,930,492	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
107年11月	金 額	7,976,313	6,954,179	14,930,492
	比 重	53.42	46.58	100.00
107年10月	金 額	8,097,607	r 6,974,545	r 15,072,152
	比 重	53.73	46.27	100.00
比較增減	差 額	-121,294	-20,366	-141,660
	變動率	-1.50	-0.29	-0.94

註：r為修正數。

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

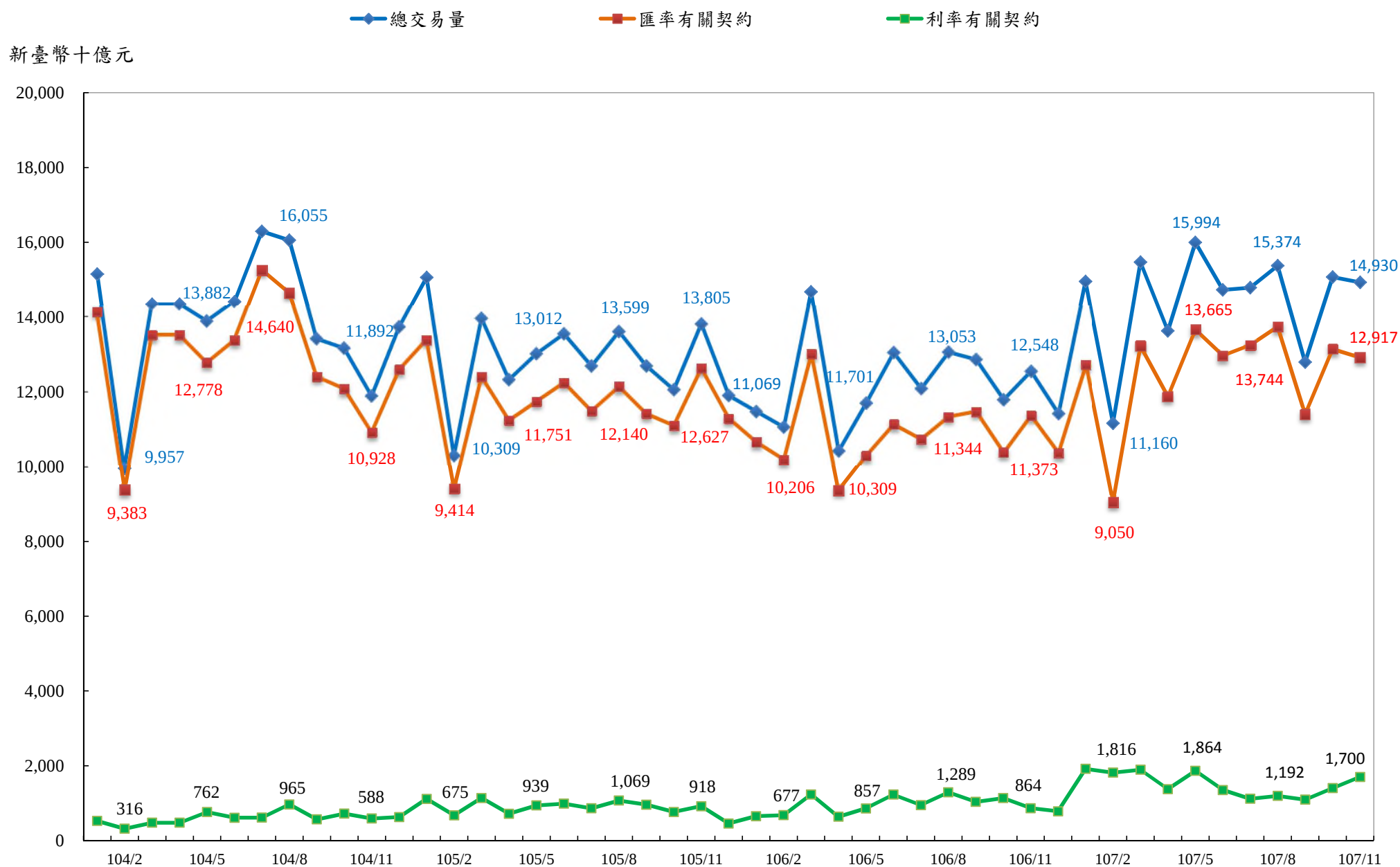
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	107年11月		107年10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)	1,700,212	11.39	r 1,398,831	9.28	301,381	21.55
(一)店頭市場(OTC)	796,517	5.34	r 605,895	4.02	190,622	31.46
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	771,400	5.17	527,343	3.50	244,057	46.28
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,015	0.01	r 1,497	0.01	518	34.60
4. 賣出選擇權(Sold Options)	23,102	0.16	77,055	0.51	-53,953	-70.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	903,695	6.05	792,936	5.26	110,759	13.97
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	442,401	2.96	391,263	2.60	51,138	13.07
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	461,124	3.09	401,317	2.66	59,807	14.90
3. 買入選擇權(Bought Options)	170	-	356	-	-186	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,916,600	86.51	13,139,781	87.18	-223,181	-1.70
(一)店頭市場(OTC)	12,863,999	86.16	13,111,603	86.99	-247,604	-1.89
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,359,638	9.11	1,526,452	10.13	-166,814	-10.93
2. 換匯(Fx Swaps)	10,747,489	71.98	10,745,791	71.30	1,698	0.02
3. 換匯換利(Currency Swaps)	128,846	0.86	196,415	1.30	-67,569	-34.40
4. 買入選擇權(Bought Options)	320,328	2.15	326,113	2.16	-5,785	-1.77
5. 賣出選擇權(Sold Options)	307,698	2.06	316,832	2.10	-9,134	-2.88
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	52,601	0.35	28,178	0.19	24,423	86.67
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	20,954	0.14	12,391	0.08	8,563	69.11
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	18,873	0.12	10,259	0.07	8,614	83.97
3. 買入選擇權(Bought Options)	6,956	0.05	3,422	0.02	3,534	103.27
4. 賣出選擇權(Sold Options)	5,818	0.04	2,106	0.02	3,712	176.26
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	294,372	1.97	510,996	3.39	-216,624	-42.39
(一)店頭市場(OTC)	1,804	0.01	13,463	0.09	-11,659	-86.60
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	292,568	1.96	497,533	3.30	-204,965	-41.20
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	11,839	0.08	14,611	0.10	-2,772	-18.97
(一)店頭市場(OTC)	8,665	0.06	8,430	0.06	235	2.79
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,174	0.02	6,181	0.04	-3,007	-48.65
小 計(一至四)	14,923,023	99.95	r 15,064,219	99.95	-141,196	-0.94
五、信用有關契約(Credit Contracts)	7,469	0.05	7,933	0.05	-464	-5.85
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	7,469	0.05	7,933	0.05	-464	-5.85
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	14,930,492	100.00	r 15,072,152	100.00	-141,660	-0.94

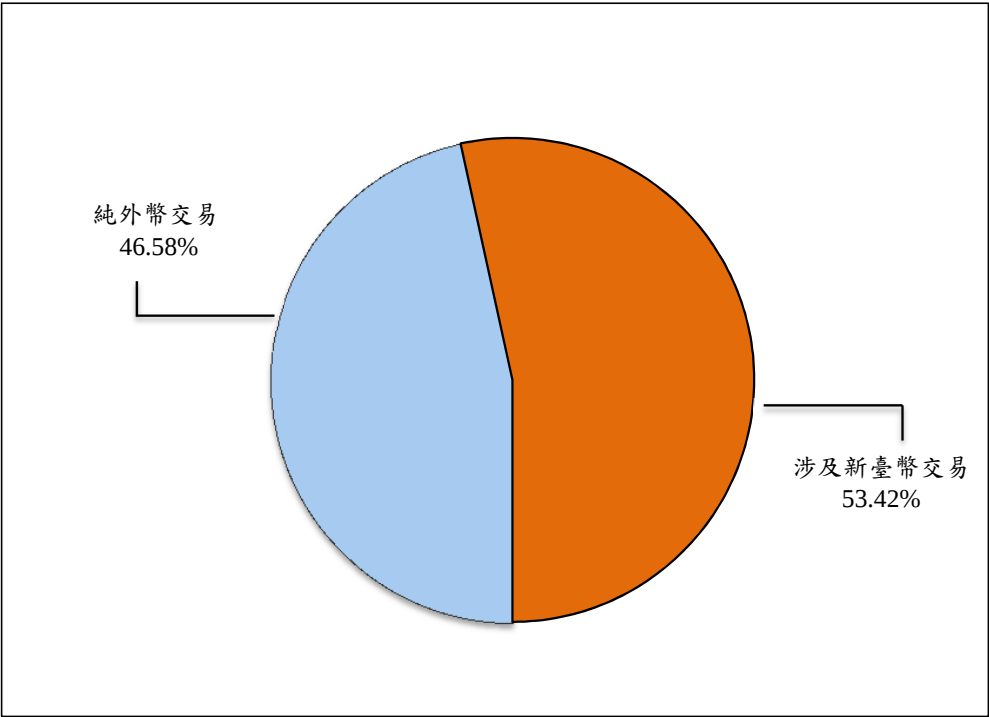
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

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2 107年11月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

