

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 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) | 243,978 | 902,858 | 1,146,836 | 8.91 |
| (一)店頭市場(OTC) | 241,841 | 246,839 | 488,680 | 3.80 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts) | 2,137 | 656,019 | 658,156 | 5.11 |
| 二、匯率有關契約 ² (Foreign Exchange Transactions) | 5,609,595 | 5,807,847 | 11,417,442 | 88.74 |
| (一)店頭市場(OTC) | 5,609,595 | 5,780,047 | 11,389,642 | 88.52 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts) | - | 27,800 | 27,800 | 0.22 |
| 三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts) | 278,622 | 5,715 | 284,337 | 2.21 |
| (一)店頭市場(OTC) | 5,495 | 81 | 5,576 | 0.04 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts) | 273,127 | 5,634 | 278,761 | 2.17 |
| 四、商品有關契約(Commodity Contracts) | 590 | 12,500 | 13,090 | 0.10 |
| (一)店頭市場(OTC) | - | 10,161 | 10,161 | 0.08 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts) | 590 | 2,339 | 2,929 | 0.02 |
| 小計(一至四) | 6,132,785 | 6,728,920 | 12,861,705 | 99.96 |
| 五、信用有關契約(Credit Contracts) | - | 4,760 | 4,760 | 0.04 |
| 六、其他有關契約(Other Contracts) | - | - | - | - |
| 總計 | 6,132,785 | 6,733,680 | 12,866,465 | 100.00 |

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. 匯率有關契約中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

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9月 | 金額 | 6,132,785 | 6,733,680 | 12,866,465 |
| | 比重 | 47.66 | 52.34 | 100.00 |
| 107年8月 | 金額 | 7,479,759 | 7,894,047 | 15,373,806 |
| | 比重 | 48.65 | 51.35 | 100.00 |
| 比較增減 | 差額 | -1,346,974 | -1,160,367 | -2,507,341 |
| | 變動率 | -18.01 | -14.70 | -16.31 |

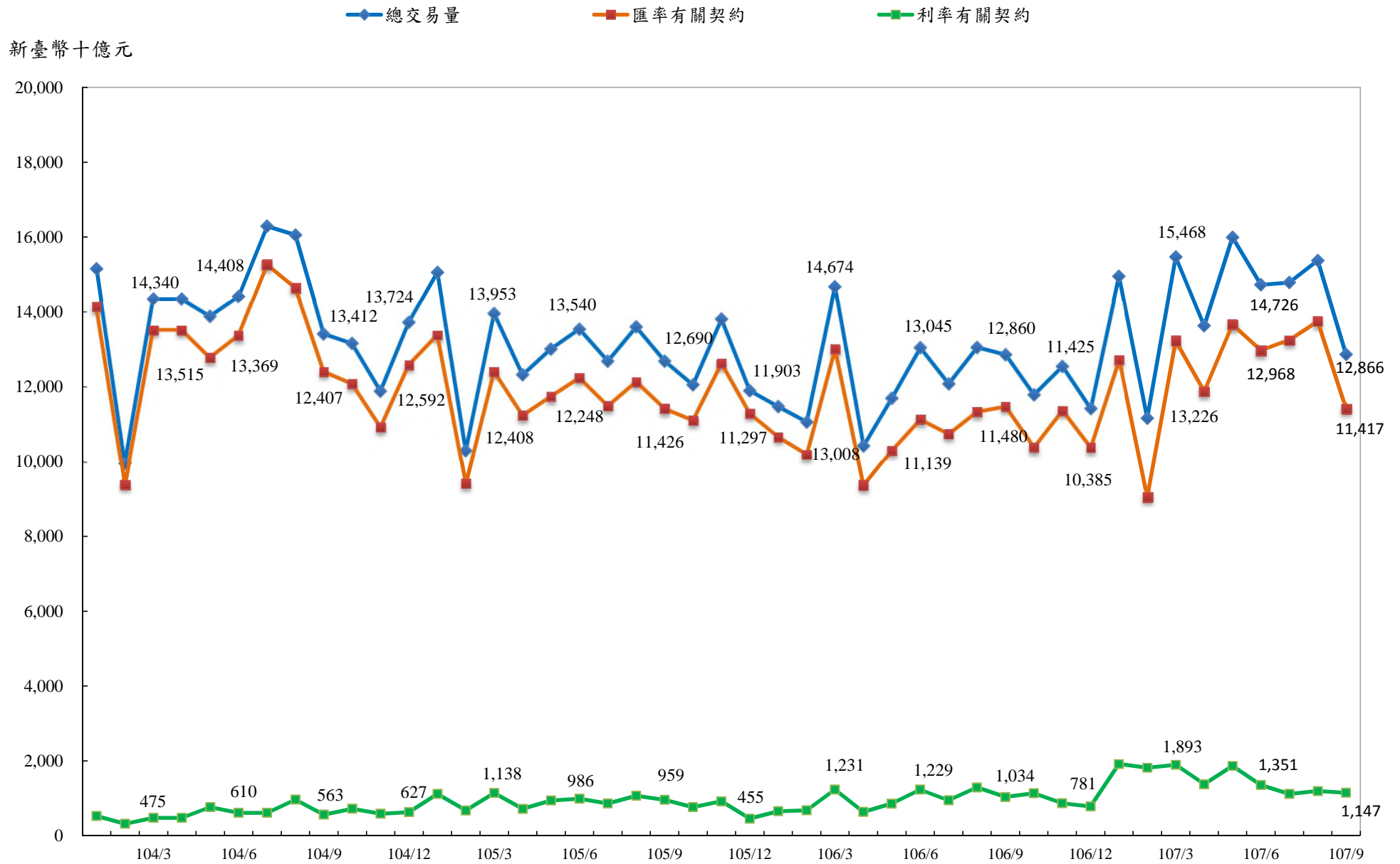
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

| 商 品 種 類 | 107年9月 | | 107年8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) | 1,146,836 | 8.91 | 1,192,425 | 7.76 | -45,589 | -3.82 |
| (一)店頭市場(OTC) | 488,680 | 3.80 | 424,995 | 2.77 | 63,685 | 14.98 |
| 1. 遠期利率協議(FRA) | - | - | - | - | - | - |
| 2. 換利(IRS) | 457,534 | 3.56 | 419,977 | 2.73 | 37,557 | 8.94 |
| 3. 買入選擇權(Bought Options) | 3,841 | 0.03 | 440 | 0.01 | 3,401 | 772.95 |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options) | 27,305 | 0.21 | 4,578 | 0.03 | 22,727 | 496.44 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts) | 658,156 | 5.11 | 767,430 | 4.99 | -109,274 | -14.24 |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions) | 341,072 | 2.65 | 386,557 | 2.51 | -45,485 | -11.77 |
| 2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions) | 317,084 | 2.46 | 380,873 | 2.48 | -63,789 | -16.75 |
| 3. 買入選擇權(Bought Options) | - | - | - | - | - | - |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options) | - | - | - | - | - | - |
| 二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions) | 11,417,442 | 88.74 | 13,743,586 | 89.40 | -2,326,144 | -16.93 |
| (一)店頭市場(OTC) | 11,389,642 | 88.52 | 13,674,036 | 88.95 | -2,284,394 | -16.71 |
| 1. 遠期契約(Outright Forwards) | 1,300,831 | 10.11 | 1,541,866 | 10.03 | -241,035 | -15.63 |
| 2. 換匯(Fx Swaps) | 9,355,855 | 72.72 | 11,154,559 | 72.56 | -1,798,704 | -16.13 |
| 3. 換匯換利(Currency Swaps) | 117,569 | 0.91 | 151,076 | 0.98 | -33,507 | -22.18 |
| 4. 買入選擇權(Bought Options) | 306,190 | 2.38 | 421,180 | 2.74 | -114,990 | -27.30 |
| 5. 賣出選擇權(Sold Options) | 309,197 | 2.40 | 405,355 | 2.64 | -96,158 | -23.72 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts) | 27,800 | 0.22 | 69,550 | 0.45 | -41,750 | -60.03 |
| 1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions) | 13,028 | 0.10 | 30,625 | 0.20 | -17,597 | -57.46 |
| 2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions) | 11,391 | 0.09 | 31,479 | 0.20 | -20,088 | -63.81 |
| 3. 買入選擇權(Bought Options) | 2,970 | 0.03 | 4,432 | 0.03 | -1,462 | -32.99 |
| 4. 賣出選擇權(Sold Options) | 411 | - | 3,014 | 0.02 | -2,603 | -86.36 |
| 三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts) | 284,337 | 2.21 | 414,310 | 2.69 | -129,973 | -31.37 |
| (一)店頭市場(OTC) | 5,576 | 0.04 | 1,732 | 0.01 | 3,844 | 221.94 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts) | 278,761 | 2.17 | 412,578 | 2.68 | -133,817 | -32.43 |
| 四、商品有關契約(Commodity Contracts) | 13,090 | 0.10 | 17,358 | 0.11 | -4,268 | -24.59 |
| (一)店頭市場(OTC) | 10,161 | 0.08 | 11,676 | 0.07 | -1,515 | -12.98 |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts) | 2,929 | 0.02 | 5,682 | 0.04 | -2,753 | -48.45 |
| 小 計(一至四) | 12,861,705 | 99.96 | 15,367,679 | 99.96 | -2,505,974 | -16.31 |
| 五、信用有關契約(Credit Contracts) | 4,760 | 0.04 | 6,127 | 0.04 | -1,367 | -22.31 |
| 1. 信用違約交換(Credit Default Swap) | 4,760 | 0.04 | 6,127 | 0.04 | -1,367 | -22.31 |
| 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 | 12,866,465 | 100.00 | 15,373,806 | 100.00 | -2,507,341 | -16.31 |

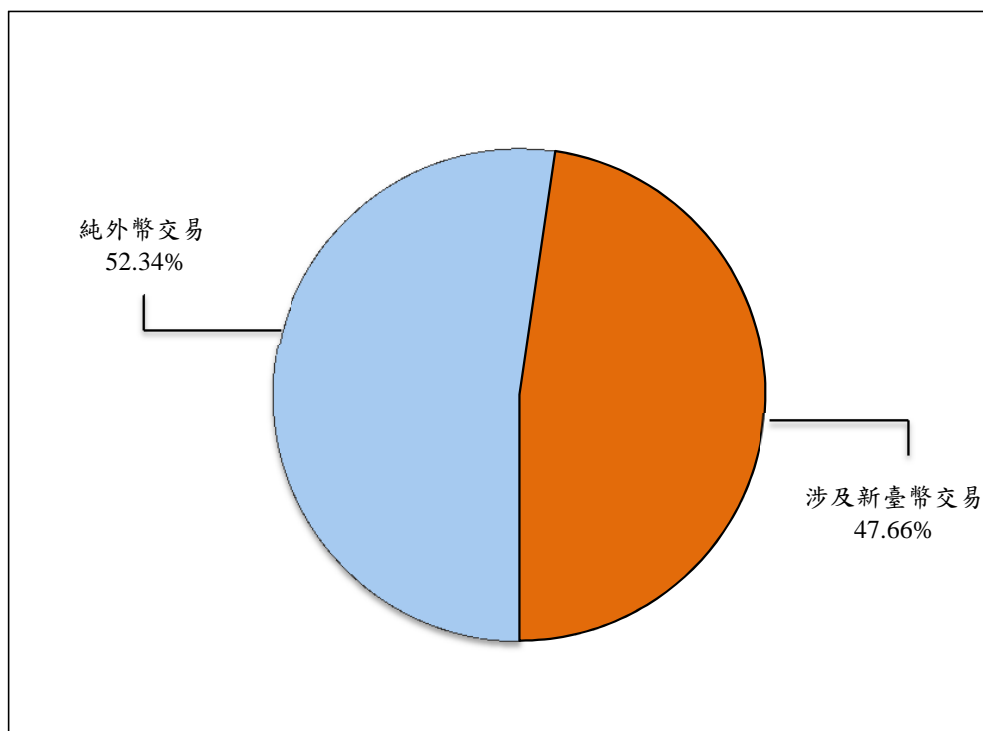
註：包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量趨勢統計



附圖2 107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

