

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10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)	365,847	1,032,674	1,398,521	9.28
（一）店頭市場(OTC)	365,847	239,738	605,585	4.02
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	792,936	792,936	5.26
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	7,239,907	5,899,874	13,139,781	87.18
（一）店頭市場(OTC)	7,239,907	5,871,696	13,111,603	86.99
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	-	28,178	28,178	0.19
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	491,036	19,960	510,996	3.39
（一）店頭市場(OTC)	13,097	366	13,463	0.09
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	477,939	19,594	497,533	3.30
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	817	13,794	14,611	0.10
（一）店頭市場(OTC)	-	8,430	8,430	0.06
（二）交易所(Exchange-traded Contracts)	817	5,364	6,181	0.04
小 計(一至四)	8,097,607	6,966,302	15,063,909	99.95
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	7,933	7,933	0.05
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	8,097,607	6,974,235	15,071,842	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10月	金 額	8,097,607	6,974,235	15,071,842
	比 重	53.73	46.27	100.00
107年9月	金 額	r 6,113,165	r 6,680,347	r12,793,512
	比 重	r 47.78	r 52.22	100.00
比較增減	差 額	1,984,442	293,888	2,278,330
	變動率	32.46	4.40	17.81

註：r為修正數。

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

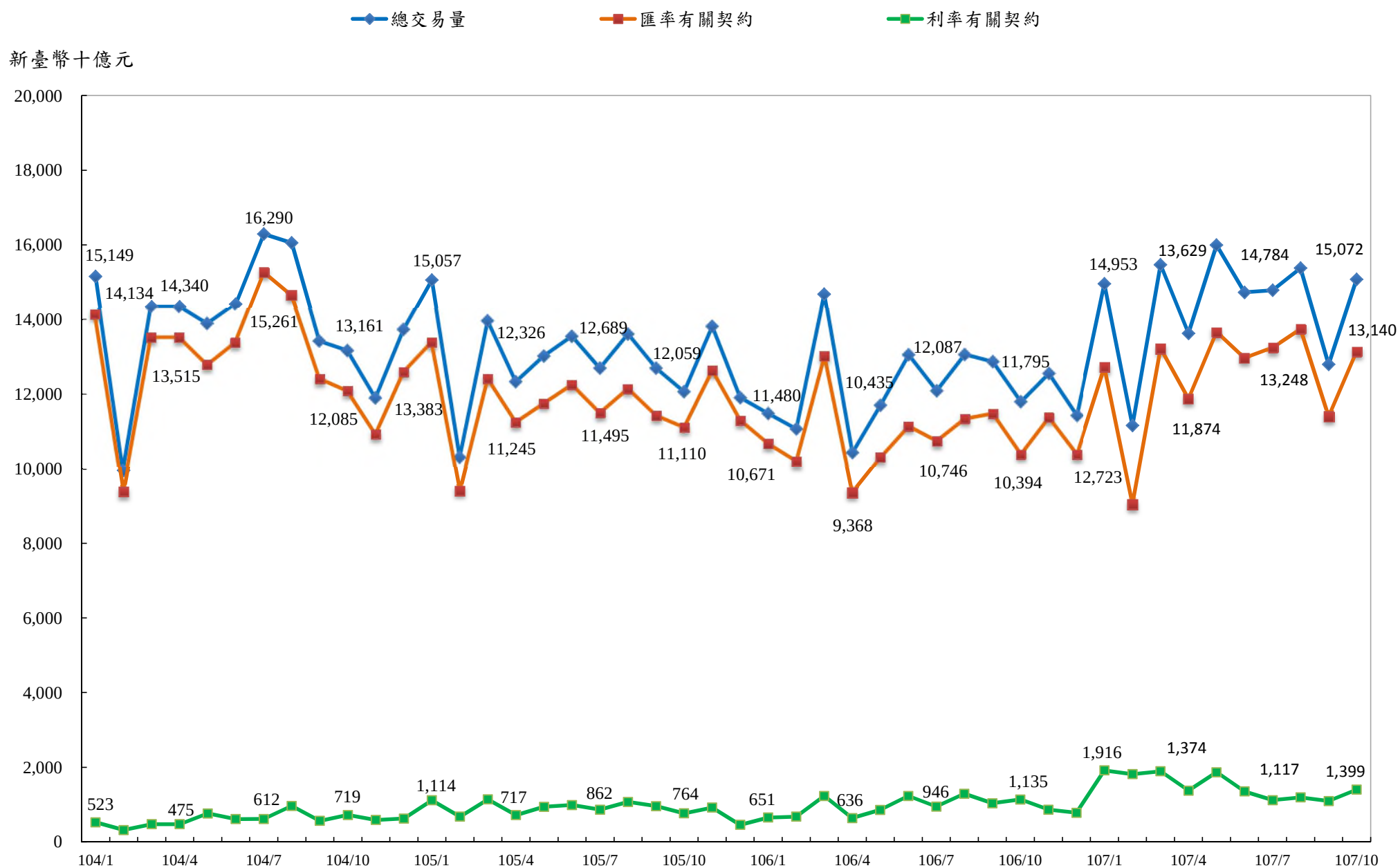
單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	107年10月		107年9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)	1,398,521	9.28	r 1,093,111	8.55	305,410	27.94
(一)店頭市場(OTC)	605,585	4.02	r 434,955	3.40	170,630	39.23
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	527,343	3.50	r 403,809	3.16	123,534	30.59
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,187	0.01	3,841	0.03	-2,654	-69.10
4. 賣出選擇權(Sold Options)	77,055	0.51	27,305	0.21	49,750	182.20
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	792,936	5.26	658,156	5.15	134,780	20.48
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	391,263	2.60	341,072	2.67	50,191	14.72
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	401,317	2.66	317,084	2.48	84,233	26.56
3. 買入選擇權(Bought Options)	356	-	-	-	356	-
4. 賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	13,139,781	87.18	r 11,398,214	89.09	1,741,567	15.28
(一)店頭市場(OTC)	13,111,603	86.99	r 11,370,414	88.88	1,741,189	15.31
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,526,452	10.13	1,300,831	10.17	225,621	17.34
2. 換匯(Fx Swaps)	10,745,791	71.30	9,355,855	73.13	1,389,936	14.86
3. 換匯換利(Currency Swaps)	196,415	1.30	r 98,341	0.77	98,074	99.73
4. 買入選擇權(Bought Options)	326,113	2.16	306,190	2.39	19,923	6.51
5. 賣出選擇權(Sold Options)	316,832	2.10	309,197	2.42	7,635	2.47
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	28,178	0.19	27,800	0.21	378	1.36
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	12,391	0.08	13,028	0.10	-637	-4.89
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	10,259	0.07	11,391	0.09	-1,132	-9.94
3. 買入選擇權(Bought Options)	3,422	0.02	2,970	0.02	452	15.22
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,106	0.02	411	-	1,695	412.41
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	510,996	3.39	284,337	2.22	226,659	79.71
(一)店頭市場(OTC)	13,463	0.09	5,576	0.04	7,887	141.45
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	497,533	3.30	278,761	2.18	218,772	78.48
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	14,611	0.10	13,090	0.10	1,521	11.62
(一)店頭市場(OTC)	8,430	0.06	10,161	0.08	-1,731	-17.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,181	0.04	2,929	0.02	3,252	111.03
小 計(一至四)	15,063,909	99.95	r 12,788,752	99.96	2,275,157	17.79
五、信用有關契約(Credit Contracts)	7,933	0.05	4,760	0.04	3,173	66.66
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	7,933	0.05	4,760	0.04	3,173	66.66
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	15,071,842	100.00	r 12,793,512	100.00	2,278,330	17.81

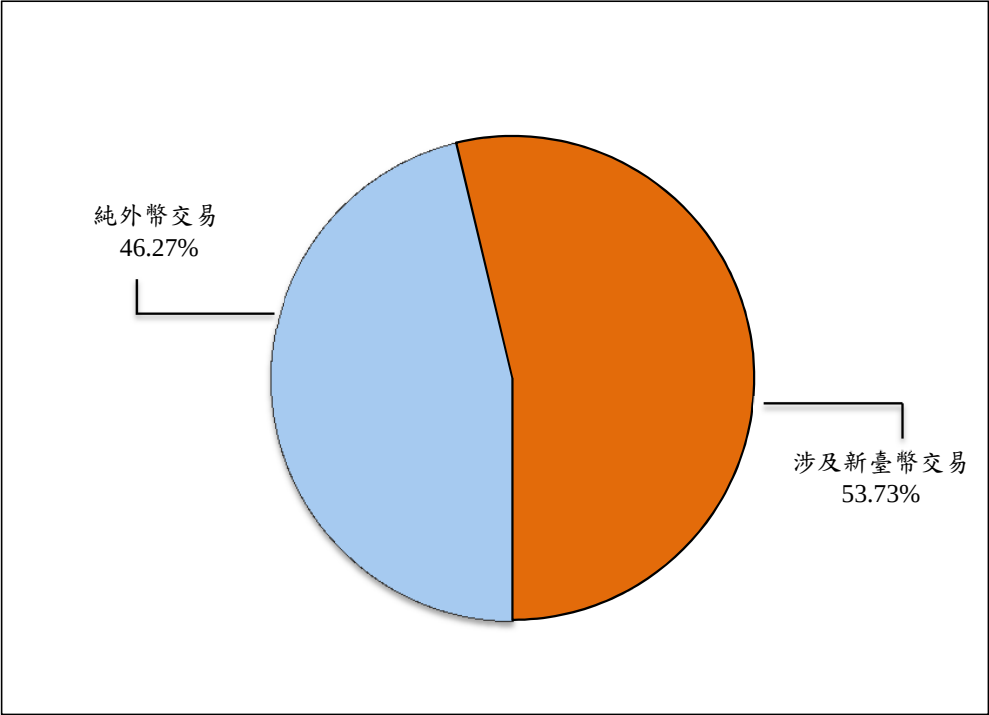
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

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10月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

