

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8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)	441,210	2,285,147	2,726,357	17.55
(一)店頭市場(OTC)	441,210	298,648	739,858	4.76
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,986,499	1,986,499	12.79
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,842,177	6,610,902	12,453,079	80.16
(一)店頭市場(OTC)	5,842,177	6,541,858	12,384,035	79.72
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	69,044	69,044	0.44
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	307,004	8,120	315,124	2.03
(一)店頭市場(OTC)	60	1,726	1,786	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	306,944	6,394	313,338	2.02
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	3,205	35,272	38,477	0.25
(一)店頭市場(OTC)	-	13,325	13,325	0.09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,205	21,947	25,152	0.16
小 計(一至四)	6,593,596	8,939,441	15,533,037	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	942	942	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,593,596	8,940,383	15,533,979	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8月	金 額	6,593,596	8,940,383	15,533,979
	比 重	42.45	57.55	100.00
108年7月	金 額	7,309,469	8,285,986	15,595,455
	比 重	46.87	53.13	100.00
比較增減	差 額	-715,873	654,397	-61,476
	變動率	-9.79	7.90	-0.39

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8月		108年7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)	2,726,357	17.55	1,521,931	9.76	1,204,426	79.14
(一)店頭市場(OTC)	739,858	4.76	741,776	4.76	-1,918	-0.26
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	711,039	4.58	696,339	4.47	14,700	2.11
3. 買入選擇權(Bought Options)	19,038	0.12	43,452	0.28	-24,414	-56.19
4. 賣出選擇權(Sold Options)	9,781	0.06	1,985	0.01	7,796	392.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,986,499	12.79	780,155	5.00	1,206,344	154.63
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	983,170	6.33	397,152	2.55	586,018	147.56
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,001,193	6.45	382,189	2.45	619,004	161.96
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,571	0.01	811	0.00	760	93.71
4. 賣出選擇權(Sold Options)	565	0.00	3	0.00	562	18,733.33
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,453,079	80.16	13,765,873	88.27	-1,312,794	-9.54
(一)店頭市場(OTC)	12,384,035	79.72	13,707,436	87.89	-1,323,401	-9.65
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,599,787	10.30	1,637,225	10.50	-37,438	-2.29
2. 換匯(Fx Swaps)	10,065,107	64.79	11,257,929	72.19	-1,192,822	-10.60
3. 換匯換利(Currency Swaps)	74,793	0.48	209,901	1.34	-135,108	-64.37
4. 買入選擇權(Bought Options)	323,368	2.08	303,481	1.94	19,887	6.55
5. 賣出選擇權(Sold Options)	320,980	2.07	298,900	1.92	22,080	7.39
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	69,044	0.44	58,437	0.38	10,607	18.15
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	31,643	0.20	26,205	0.17	5,438	20.75
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	32,407	0.21	25,882	0.17	6,525	25.21
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,602	0.02	2,918	0.02	-316	-10.83
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,392	0.01	3,432	0.02	-1,040	-30.30
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	315,124	2.03	272,777	1.75	42,347	15.52
(一)店頭市場(OTC)	1,786	0.01	2,345	0.02	-559	-23.84
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	313,338	2.02	270,432	1.73	42,906	15.87
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	38,477	0.25	33,332	0.21	5,145	15.44
(一)店頭市場(OTC)	13,325	0.09	12,683	0.08	642	5.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	25,152	0.16	20,649	0.13	4,503	21.81
小 計(一至四)	15,533,037	99.99	15,593,913	99.99	-60,876	-0.39
五、信用有關契約(Credit Contracts)	942	0.01	1,542	0.01	-600	-38.91
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	942	0.01	1,542	0.01	-600	-38.91
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	15,533,979	100.00	15,595,455	100.00	-61,476	-0.39

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。