

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			
	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)	459,498	1,281,128	1,740,626	11.67
(一)店頭市場(OTC)	459,498	124,708	584,206	3.92
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,156,420	1,156,420	7.75
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,265,635	6,506,547	12,772,182	85.67
(一)店頭市場(OTC)	6,265,635	6,446,867	12,712,502	85.27
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	59,680	59,680	0.40
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	357,595	10,729	368,324	2.47
(一)店頭市場(OTC)	40	825	865	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	357,555	9,904	367,459	2.46
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	2,466	19,449	21,915	0.15
(一)店頭市場(OTC)	-	9,620	9,620	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,466	9,829	12,295	0.08
小計(一至四)	7,085,194	7,817,853	14,903,047	99.96
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	6,087	6,087	0.04
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總計	7,085,194	7,823,940	14,909,134	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10月	金額	7,085,194	7,823,940	14,909,134
	比重	47.52	52.48	100.00
108年9月	金額	6,534,360	r 7,500,204	r 14,034,564
	比重	r 46.56	r 53.44	100.00
比較增減	差額	550,834	323,736	874,570
	變動率	8.43	4.32	6.23

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	108年10月		108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)	1,740,626	11.67	r 1,470,410	10.47	270,216	18.38
(一)店頭市場(OTC)	584,206	3.92	587,322	4.18	-3,116	-0.53
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	571,219	3.83	532,746	3.80	38,473	7.22
3. 買入選擇權(Bought Options)	5,224	0.04	41,335	0.29	-36,111	-87.36
4. 賣出選擇權(Sold Options)	7,763	0.05	13,241	0.09	-5,478	-41.37
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,156,420	7.75	r 883,088	6.29	273,332	30.95
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	592,781	3.97	r 418,052	2.98	174,729	41.80
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	560,928	3.76	r 463,546	3.30	97,382	21.01
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,218	0.01	947	0.01	271	28.62
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,493	0.01	543	0.00	950	174.95
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	12,772,182	85.67	12,271,438	87.44	500,744	4.08
(一)店頭市場(OTC)	12,712,502	85.27	12,222,178	87.09	490,324	4.01
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,621,807	10.88	1,648,338	11.75	-26,531	-1.61
2. 換匯(Fx Swaps)	10,472,403	70.24	9,953,790	70.92	518,613	5.21
3. 換匯換利(Currency Swaps)	73,278	0.49	113,619	0.81	-40,341	-35.51
4. 買入選擇權(Bought Options)	276,120	1.85	258,494	1.84	17,626	6.82
5. 賣出選擇權(Sold Options)	268,894	1.81	247,937	1.77	20,957	8.45
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	59,680	0.40	49,260	0.35	10,420	21.15
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	28,783	0.19	22,272	0.16	6,511	29.23
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	27,373	0.19	21,282	0.15	6,091	28.62
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,653	0.01	2,594	0.02	-941	-36.28
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,871	0.01	3,112	0.02	-1,241	-39.88
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	368,324	2.47	265,191	1.89	103,133	38.89
(一)店頭市場(OTC)	865	0.01	1,808	0.01	-943	-52.16
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	367,459	2.46	263,383	1.88	104,076	39.52
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	21,915	0.15	26,439	0.19	-4,524	-17.11
(一)店頭市場(OTC)	9,620	0.07	6,542	0.05	3,078	47.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	12,295	0.08	19,897	0.14	-7,602	-38.21
小 計(一至四)	14,903,047	99.96	r 14,033,478	99.99	869,569	6.20
五、信用有關契約(Credit Contracts)	6,087	0.04	1,086	0.01	5,001	460.50
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	6,087	0.04	1,086	0.01	5,001	460.50
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	14,909,134	100.00	r 14,034,564	100.00	874,570	6.23

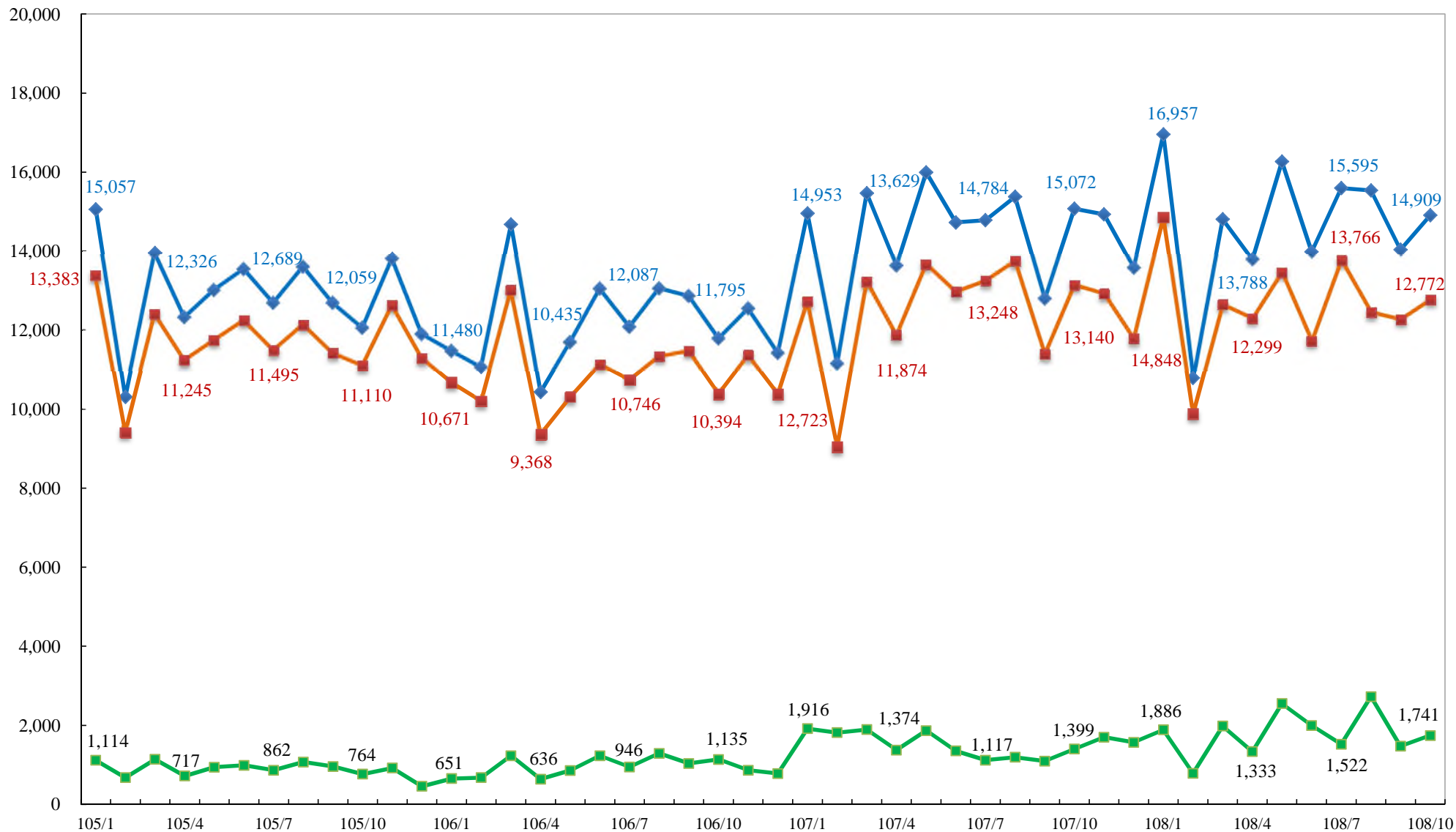
註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

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

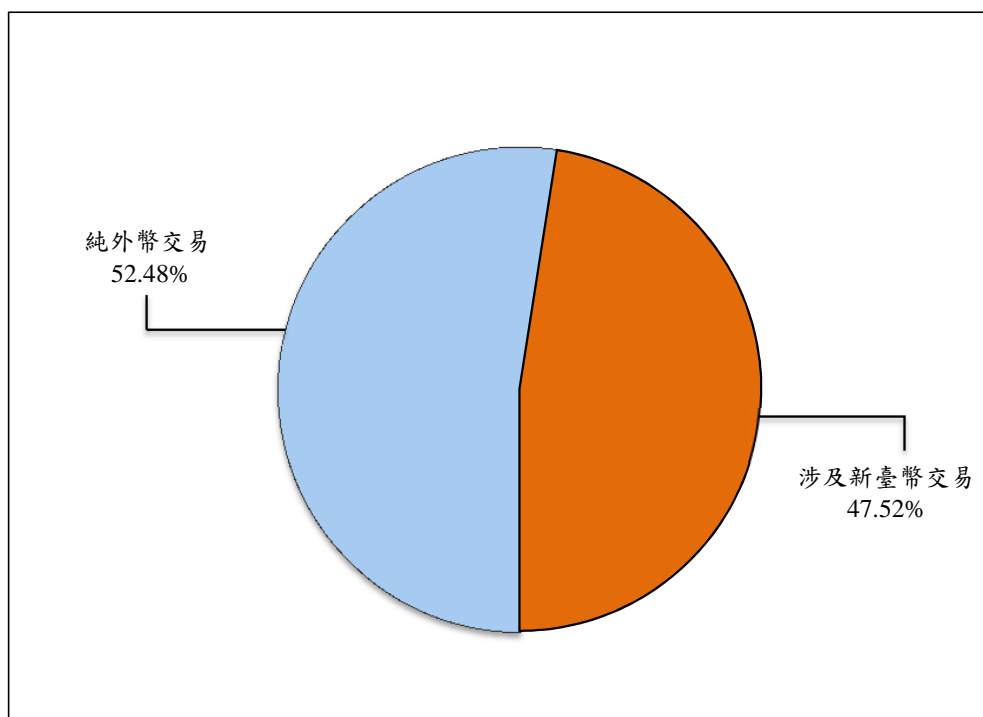
◆ 總交易量
 ■ 匯率有關契約
 ■ 利率有關契約

新臺幣十億元



附圖2 108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

