

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			
	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)	420,708	850,034	1,270,742	9.17
(一)店頭市場(OTC)	420,708	135,446	556,154	4.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	714,588	714,588	5.16
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,892,409	6,221,884	12,114,293	87.45
(一)店頭市場(OTC)	5,892,409	6,171,817	12,064,226	87.09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	50,067	50,067	0.36
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	439,768	11,357	451,125	3.26
(一)店頭市場(OTC)	72	2,894	2,966	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	439,696	8,463	448,159	3.24
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	1,369	14,674	16,043	0.11
(一)店頭市場(OTC)	-	6,534	6,534	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,369	8,140	9,509	0.07
小計(一至四)	6,754,254	7,097,949	13,852,203	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,038	1,038	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總計	6,754,254	7,098,987	13,853,241	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11月	金額	6,754,254	7,098,987	13,853,241
	比重	48.76	51.24	100.00
108年10月	金額	7,085,194	7,823,940	14,909,134
	比重	47.52	52.48	100.00
比較增減	差額	-330,940	-724,953	-1,055,893
	變動率	-4.67	-9.27	-7.08

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；%

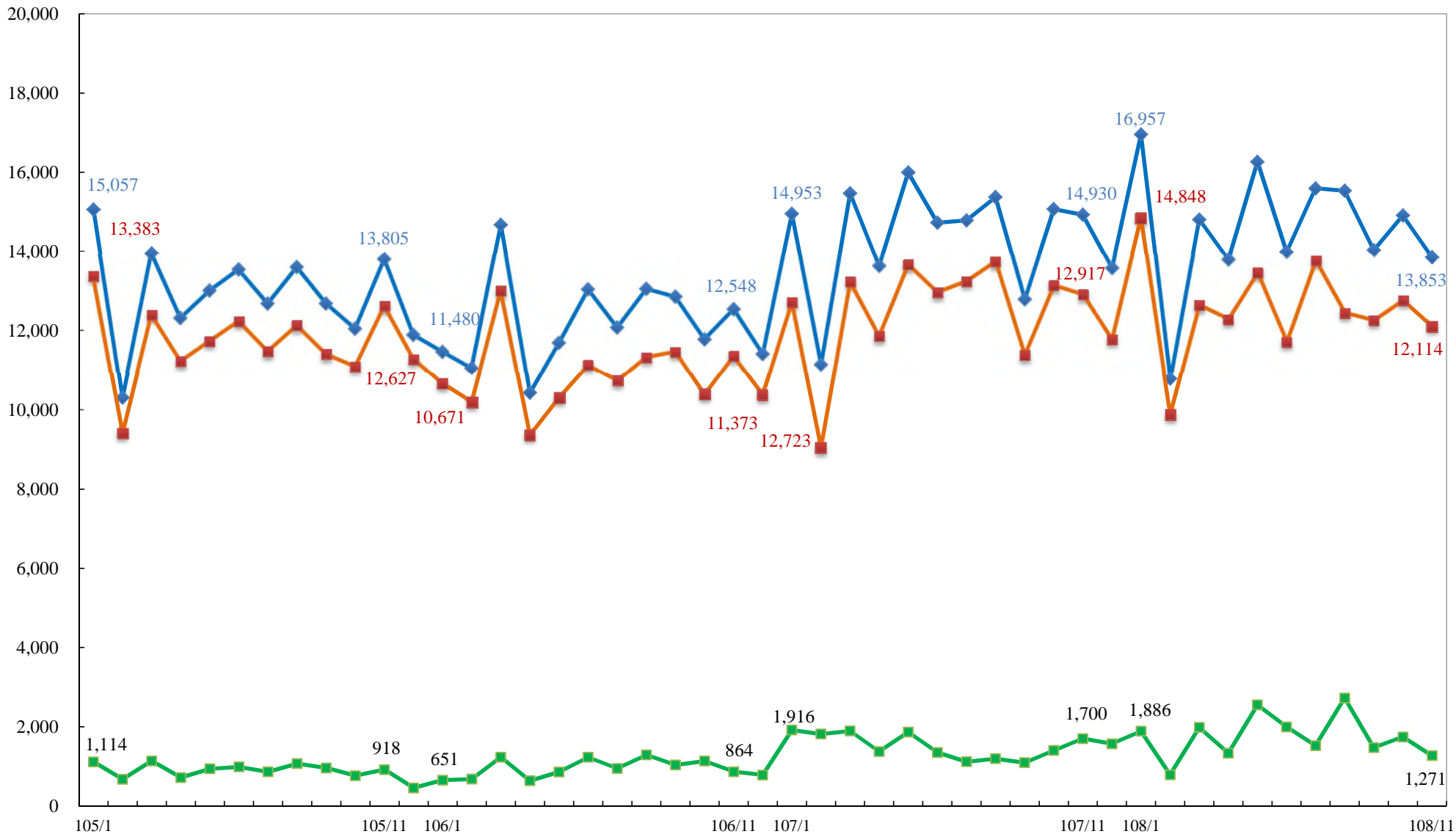
商 品 種 類	108年11月		108年10月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	1,270,742	9.17	1,740,626	11.67	-469,884	-27.00
(一)店頭市場(OTC)	556,154	4.01	584,206	3.92	-28,052	-4.80
1. 遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2. 換利(IRS)	503,215	3.63	571,219	3.83	-68,004	-11.91
3. 買入選擇權(Bought Options)	7,196	0.05	5,224	0.04	1,972	37.75
4. 賣出選擇權(Sold Options)	45,743	0.33	7,763	0.05	37,980	489.24
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	714,588	5.16	1,156,420	7.75	-441,832	-38.21
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	350,996	2.53	592,781	3.97	-241,785	-40.79
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	361,150	2.61	560,928	3.76	-199,778	-35.62
3. 買入選擇權(Bought Options)	1,221	0.01	1,218	0.01	3	0.25
4. 賣出選擇權(Sold Options)	1,221	0.01	1,493	0.01	-272	-18.22
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	12,114,293	87.45	12,772,182	85.67	-657,889	-5.15
(一)店頭市場(OTC)	12,064,226	87.09	12,712,502	85.27	-648,276	-5.10
1. 遠期契約(Outright Forwards)	1,556,890	11.24	1,621,807	10.88	-64,917	-4.00
2. 換匯(Fx Swaps)	10,022,270	72.34	10,472,403	70.24	-450,133	-4.30
3. 換匯換利(Currency Swaps)	64,653	0.47	73,278	0.49	-8,625	-11.77
4. 買入選擇權(Bought Options)	213,109	1.54	276,120	1.85	-63,011	-22.82
5. 賣出選擇權(Sold Options)	207,304	1.50	268,894	1.81	-61,590	-22.90
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	50,067	0.36	59,680	0.40	-9,613	-16.11
1. 期貨-長部位(Futures - Long Positions)	22,776	0.16	28,783	0.19	-6,007	-20.87
2. 期貨-短部位(Futures - Short Positions)	22,319	0.16	27,373	0.19	-5,054	-18.46
3. 買入選擇權(Bought Options)	2,542	0.02	1,653	0.01	889	53.78
4. 賣出選擇權(Sold Options)	2,430	0.02	1,871	0.01	559	29.88
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	451,125	3.26	368,324	2.47	82,801	22.48
(一)店頭市場(OTC)	2,966	0.02	865	0.01	2,101	242.89
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	448,159	3.24	367,459	2.46	80,700	21.96
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	16,043	0.11	21,915	0.15	-5,872	-26.79
(一)店頭市場(OTC)	6,534	0.04	9,620	0.07	-3,086	-32.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	9,509	0.07	12,295	0.08	-2,786	-22.66
<b>小 計(一至四)</b>	13,852,203	99.99	14,903,047	99.96	-1,050,844	-7.05
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	1,038	0.01	6,087	0.04	-5,049	-82.95
1. 信用違約交換(Credit Default Swap)	1,038	0.01	6,087	0.04	-5,049	-82.95
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)	-	-	-	-	-	-
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	-	-	-	-	-	-
1. 遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2. 交換(Swaps)	-	-	-	-	-	-
3. 選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
<b>總 計</b>	13,853,241	100.00	14,909,134	100.00	-1,055,893	-7.08

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

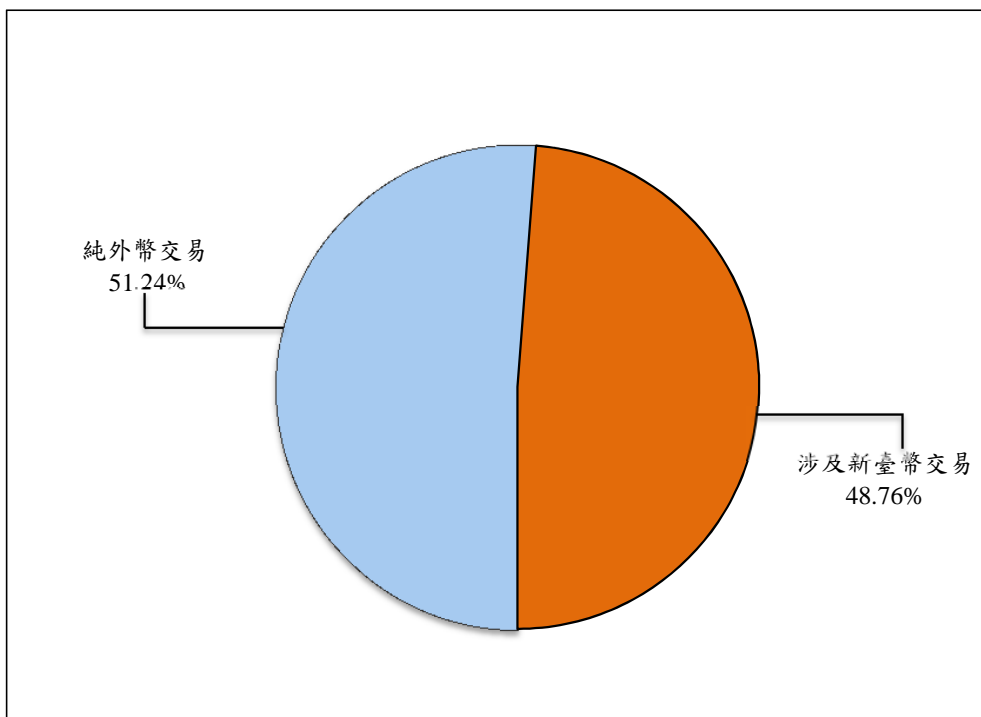
◆ 總交易量      ■ 匯率有關契約      ■ 利率有關契約

新臺幣十億元



附圖2 108年11月銀行衍生性金融商品交易量內容分析

幣別



銀行類別

