

# 附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

## 商 品 種 類 別

110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			
	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)	296,294	812,015	1,108,309	8.99
(一)店頭市場(OTC)	296,294	253,150	549,444	4.46
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	558,865	558,865	4.53
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,103,792	5,981,523	11,085,315	89.87
(一)店頭市場(OTC)	5,103,792	5,970,569	11,074,361	89.78
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	10,954	10,954	0.09
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	118,069	12,828	130,897	1.06
(一)店頭市場(OTC)	61	1,141	1,202	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	118,008	11,687	129,695	1.05
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	7,962	7,962	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	6,736	6,736	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,226	1,226	0.01
小 計(一至四)	5,518,155	6,814,328	12,332,483	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,366	2,366	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,518,155	6,816,694	12,334,849	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
110年9月	金 額	5,518,155	6,816,694	12,334,849
	比 重	44.74	55.26	100.00
110年8月	金 額	5,490,317	7,104,836	12,595,153
	比 重	43.59	56.41	100.00
比較增減	差 額	27,838	-288,142	-260,304
	變動率	0.51	-4.06	-2.07

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	110年9月		110年8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>	<b>1,108,309</b>	<b>8.99</b>	<b>971,960</b>	<b>7.72</b>	<b>136,349</b>	<b>14.03</b>
(一)店頭市場(OTC)	549,444	4.46	428,438	3.40	121,006	28.24
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	499,549	4.05	379,466	3.01	120,083	31.65
3.買入選擇權(Bought Options)	22,496	0.19	23,673	0.19	-1,177	-4.97
4.賣出選擇權(Sold Options)	27,399	0.22	25,299	0.20	2,100	8.30
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	558,865	4.53	543,522	4.32	15,343	2.82
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	284,032	2.30	253,227	2.01	30,805	12.16
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	274,833	2.23	290,295	2.31	-15,462	-5.33
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	<b>11,085,315</b>	<b>89.87</b>	<b>11,457,593</b>	<b>90.97</b>	<b>-372,278</b>	<b>-3.25</b>
(一)店頭市場(OTC)	11,074,361	89.78	11,451,587	90.92	-377,226	-3.29
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,098,176	8.90	1,226,360	9.74	-128,184	-10.45
2.換匯(Fx Swaps)	9,276,691	75.21	9,467,947	75.17	-191,256	-2.02
3.換匯換利(Currency Swaps)	84,258	0.68	115,870	0.92	-31,612	-27.28
4.買入選擇權(Bought Options)	308,617	2.50	325,562	2.58	-16,945	-5.20
5.賣出選擇權(Sold Options)	306,619	2.49	315,848	2.51	-9,229	-2.92
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	10,954	0.09	6,006	0.05	4,948	82.38
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	5,272	0.04	3,060	0.03	2,212	72.29
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	5,682	0.05	2,946	0.02	2,736	92.87
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	<b>130,897</b>	<b>1.06</b>	<b>154,609</b>	<b>1.23</b>	<b>-23,712</b>	<b>-15.34</b>
(一)店頭市場(OTC)	1,202	0.01	1,471	0.01	-269	-18.29
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	129,695	1.05	153,138	1.22	-23,443	-15.31
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	<b>7,962</b>	<b>0.06</b>	<b>10,713</b>	<b>0.08</b>	<b>-2,751</b>	<b>-25.68</b>
(一)店頭市場(OTC)	6,736	0.05	7,349	0.06	-613	-8.34
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,226	0.01	3,364	0.02	-2,138	-63.56
<b>小計(一至四)</b>	<b>12,332,483</b>	<b>99.98</b>	<b>12,594,875</b>	<b>100.00</b>	<b>-262,392</b>	<b>-2.08</b>
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	<b>2,366</b>	<b>0.02</b>	<b>278</b>	<b>0.00</b>	<b>2,088</b>	<b>751.08</b>
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,366	0.02	278	0.00	2,088	751.08
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>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
1.遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2.交換(Swaps)	-	-	-	-	-	-
3.選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
<b>總計</b>	<b>12,334,849</b>	<b>100.00</b>	<b>12,595,153</b>	<b>100.00</b>	<b>-260,304</b>	<b>-2.07</b>

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。