

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)	566,404	1,316,340	1,882,744	14.74
(一)店頭市場(OTC)	566,404	629,999	1,196,403	9.37
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	686,341	686,341	5.37
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,162,202	5,601,948	10,764,150	84.25
(一)店頭市場(OTC)	5,162,202	5,594,476	10,756,678	84.19
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	7,472	7,472	0.06
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	107,556	12,195	119,751	0.94
(一)店頭市場(OTC)	591	1,295	1,886	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	106,965	10,900	117,865	0.92
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	8,076	8,076	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	6,200	6,200	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,876	1,876	0.01
小 計(一至四)	5,836,162	6,938,559	12,774,721	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,808	1,808	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,836,162	6,940,367	12,776,529	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10月	金 額	5,836,162	6,940,367	12,776,529
	比 重	45.68	54.32	100.00
110年9月	金 額	5,518,155	6,816,694	12,334,849
	比 重	44.74	55.26	100.00
比較增減	差 額	318,007	123,673	441,680
	變 動 率	5.76	1.81	3.58

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺¹

商品種類	110年10月		110年9月		比較
	合計	比重	合計	比重	差額
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	1,882,744	14.74	1,108,309	8.99	774,435
(一)店頭市場(OTC)	1,196,403	9.37	549,444	4.46	646,959
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,079,461	8.45	499,549	4.05	579,912
3.買入選擇權(Bought Options)	50,253	0.40	22,496	0.19	27,757
4.賣出選擇權(Sold Options)	66,689	0.52	27,399	0.22	39,290
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	686,341	5.37	558,865	4.53	127,476
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	335,717	2.63	284,032	2.30	51,685
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	350,624	2.74	274,833	2.23	75,791
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,764,150	84.25	11,085,315	89.87	-321,165
(一)店頭市場(OTC)	10,756,678	84.19	11,074,361	89.78	-317,683
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,091,612	8.54	1,098,176	8.90	-6,564
2.換匯(Fx Swaps)	9,051,227	70.84	9,276,691	75.21	-225,464
3.換匯換利(Currency Swaps)	65,681	0.52	84,258	0.68	-18,577
4.買入選擇權(Bought Options)	276,069	2.16	308,617	2.50	-32,548
5.賣出選擇權(Sold Options)	272,089	2.13	306,619	2.49	-34,530
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,472	0.06	10,954	0.09	-3,482
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	3,589	0.03	5,272	0.04	-1,683
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	3,883	0.03	5,682	0.05	-1,799
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	119,751	0.94	130,897	1.06	-11,146
(一)店頭市場(OTC)	1,886	0.02	1,202	0.01	684
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	117,865	0.92	129,695	1.05	-11,830
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	8,076	0.06	7,962	0.06	114
(一)店頭市場(OTC)	6,200	0.05	6,736	0.05	-536
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,876	0.01	1,226	0.01	650
小計(一至四)	12,774,721	99.99	12,332,483	99.98	442,238
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,808	0.01	2,366	0.02	-558
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,808	0.01	2,366	0.02	-558
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	12,776,529	100.00	12,334,849	100.00	441,680

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。

