

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表 商 品 種 類 別

111年6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)	638,835	1,219,799	1,858,634	13.23
(一)店頭市場(OTC)	638,835	321,987	960,822	6.84
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	897,812	897,812	6.39
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,515,533	6,572,531	12,088,064	86.07
(一)店頭市場(OTC)	5,515,533	6,565,021	12,080,554	86.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	7,510	7,510	0.06
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	73,778	13,048	86,826	0.62
(一)店頭市場(OTC)	53	364	417	0.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	73,725	12,684	86,409	0.62
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	9,491	9,491	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	7,969	7,969	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,522	1,522	0.01
小 計(一至四)	6,228,146	7,814,869	14,043,015	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,939	1,939	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,228,146	7,816,808	14,044,954	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
111年6月	金 額	6,228,146	7,816,808	14,044,954
	比 重	44.34	55.66	100.00
111年5月	金 額	5,887,712	6,814,305	12,702,017
	比 重	46.35	53.65	100.00
比較增減	差 額	340,434	1,002,503	1,342,937
	變動率	5.78	14.71	10.57

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	111年6月		111年5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)	1,858,634	13.23	1,349,894	10.63	508,740	37.69
(一)店頭市場(OTC)	960,822	6.84	533,673	4.20	427,149	80.04
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	913,134	6.50	509,634	4.01	403,500	79.17
3.買入選擇權(Bought Options)	33,012	0.24	10,622	0.08	22,390	210.79
4.賣出選擇權(Sold Options)	14,676	0.10	13,417	0.11	1,259	9.38
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	897,812	6.39	816,221	6.43	81,591	10.00
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	477,943	3.40	415,216	3.27	62,727	15.11
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	419,869	2.99	401,005	3.16	18,864	4.70
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)	12,088,064	86.07	11,246,526	88.54	841,538	7.48
(一)店頭市場(OTC)	12,080,554	86.01	11,243,182	88.52	837,372	7.45
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,146,953	8.17	1,221,104	9.61	-74,151	-6.07
2.換匯(Fx Swaps)	10,375,094	73.87	9,463,597	74.51	911,497	9.63
3.換匯換利(Currency Swaps)	64,422	0.46	33,039	0.26	31,383	94.99
4.買入選擇權(Bought Options)	247,941	1.76	261,692	2.06	-13,751	-5.25
5.賣出選擇權(Sold Options)	246,144	1.75	263,750	2.08	-17,606	-6.68
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,510	0.06	3,344	0.02	4,166	124.58
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	3,777	0.03	1,710	0.01	2,067	120.88
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	3,733	0.03	1,634	0.01	2,099	128.46
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)	86,826	0.62	92,519	0.73	-5,693	-6.15
(一)店頭市場(OTC)	417	0.00	477	0.00	-60	-12.58
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	86,409	0.62	92,042	0.73	-5,633	-6.12
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	9,491	0.07	10,586	0.08	-1,095	-10.34
(一)店頭市場(OTC)	7,969	0.06	8,487	0.07	-518	-6.10
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,522	0.01	2,099	0.01	-577	-27.49
小 計(一至四)	14,043,015	99.99	12,699,525	99.98	1,343,490	10.58
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,939	0.01	2,492	0.02	-553	-22.19
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,939	0.01	2,492	0.02	-553	-22.19
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	14,044,954	100.00	12,702,017	100.00	1,342,937	10.57

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。