

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7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)	669,640	1,220,035	1,889,675	12.75
(一)店頭市場(OTC)	669,640	152,743	822,383	5.55
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,067,292	1,067,292	7.20
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,116,683	6,703,876	12,820,559	86.53
(一)店頭市場(OTC)	6,116,683	6,700,869	12,817,552	86.51
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,007	3,007	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	83,177	16,275	99,452	0.67
(一)店頭市場(OTC)	37	248	285	0.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	83,140	16,027	99,167	0.67
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	6,400	6,400	0.04
(一)店頭市場(OTC)	-	5,207	5,207	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,193	1,193	0.01
小 計(一至四)	6,869,500	7,946,586	14,816,086	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,290	1,290	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,869,500	7,947,876	14,817,376	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7月	金 額	6,869,500	7,947,876	14,817,376
	比 重	46.36	53.64	100.00
111年6月	金 額	6,228,146	7,816,808	14,044,954
	比 重	44.34	55.66	100.00
比較增減	差 額	641,354	131,068	772,422
	變動率	10.30	1.68	5.50

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7月		111年6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)	1,889,675	12.75	1,858,634	13.23	31,041	1.67
(一)店頭市場(OTC)	822,383	5.55	960,822	6.84	-138,439	-14.41
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	757,286	5.11	913,134	6.50	-155,848	-17.07
3.買入選擇權(Bought Options)	34,457	0.23	33,012	0.24	1,445	4.38
4.賣出選擇權(Sold Options)	30,640	0.21	14,676	0.10	15,964	108.78
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,067,292	7.20	897,812	6.39	169,480	18.88
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	515,839	3.48	477,943	3.40	37,896	7.93
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	551,453	3.72	419,869	2.99	131,584	31.34
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)	12,820,559	86.53	12,088,064	86.07	732,495	6.06
(一)店頭市場(OTC)	12,817,552	86.51	12,080,554	86.01	736,998	6.10
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,155,179	7.80	1,146,953	8.17	8,226	0.72
2.換匯(Fx Swaps)	11,042,319	74.52	10,375,094	73.87	667,225	6.43
3.換匯換利(Currency Swaps)	20,795	0.14	64,422	0.46	-43,627	-67.72
4.買入選擇權(Bought Options)	299,834	2.03	247,941	1.76	51,893	20.93
5.賣出選擇權(Sold Options)	299,425	2.02	246,144	1.75	53,281	21.65
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,007	0.02	7,510	0.06	-4,503	-59.96
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,487	0.01	3,777	0.03	-2,290	-60.63
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,520	0.01	3,733	0.03	-2,213	-59.28
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)	99,452	0.67	86,826	0.62	12,626	14.54
(一)店頭市場(OTC)	285	0.00	417	0.00	-132	-31.65
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	99,167	0.67	86,409	0.62	12,758	14.76
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	6,400	0.04	9,491	0.07	-3,091	-32.57
(一)店頭市場(OTC)	5,207	0.03	7,969	0.06	-2,762	-34.66
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,193	0.01	1,522	0.01	-329	-21.62
小 計(一至四)	14,816,086	99.99	14,043,015	99.99	773,071	5.51
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,290	0.01	1,939	0.01	-649	-33.47
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,290	0.01	1,939	0.01	-649	-33.47
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	14,817,376	100.00	14,044,954	100.00	772,422	5.50

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。