

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8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)	439,291	1,399,013	1,838,304	11.37
(一)店頭市場(OTC)	439,291	265,067	704,358	4.36
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,133,946	1,133,946	7.01
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,293,513	6,918,745	14,212,258	87.88
(一)店頭市場(OTC)	7,293,513	6,914,012	14,207,525	87.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,733	4,733	0.03
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	95,911	13,367	109,278	0.68
(一)店頭市場(OTC)	43	563	606	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	95,868	12,804	108,672	0.67
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	10,065	10,065	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	8,921	8,921	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,144	1,144	0.01
小 計(一至四)	7,828,715	8,341,190	16,169,905	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,405	2,405	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,828,715	8,343,595	16,172,310	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8月	金 額	7,828,715	8,343,595	16,172,310
	比 重	48.41	51.59	100.00
111年7月	金 額	6,869,500	7,947,876	14,817,376
	比 重	46.36	53.64	100.00
比較增減	差 額	959,215	395,719	1,354,934
	變動率	13.96	4.98	9.14

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8月		111年7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)	1,838,304	11.37	1,889,675	12.75	-51,371	-2.72
(一)店頭市場(OTC)	704,358	4.36	822,383	5.55	-118,025	-14.35
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	620,172	3.84	757,286	5.11	-137,114	-18.11
3.買入選擇權(Bought Options)	36,217	0.22	34,457	0.23	1,760	5.11
4.賣出選擇權(Sold Options)	47,969	0.30	30,640	0.21	17,329	56.56
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,133,946	7.01	1,067,292	7.20	66,654	6.25
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	557,107	3.44	515,839	3.48	41,268	8.00
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	576,839	3.57	551,453	3.72	25,386	4.60
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)	14,212,258	87.88	12,820,559	86.53	1,391,699	10.86
(一)店頭市場(OTC)	14,207,525	87.85	12,817,552	86.51	1,389,973	10.84
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,432,338	8.86	1,155,179	7.80	277,159	23.99
2.換匯(Fx Swaps)	12,101,329	74.83	11,042,319	74.52	1,059,010	9.59
3.換匯換利(Currency Swaps)	40,965	0.25	20,795	0.14	20,170	96.99
4.買入選擇權(Bought Options)	317,238	1.96	299,834	2.03	17,404	5.80
5.賣出選擇權(Sold Options)	315,655	1.95	299,425	2.02	16,230	5.42
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,733	0.03	3,007	0.02	1,726	57.40
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,922	0.01	1,487	0.01	435	29.25
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,811	0.02	1,520	0.01	1,291	84.93
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)	109,278	0.68	99,452	0.67	9,826	9.88
(一)店頭市場(OTC)	606	0.01	285	0.00	321	112.63
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	108,672	0.67	99,167	0.67	9,505	9.58
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,065	0.06	6,400	0.04	3,665	57.27
(一)店頭市場(OTC)	8,921	0.05	5,207	0.03	3,714	71.33
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,144	0.01	1,193	0.01	-49	-4.11
小 計(一至四)	16,169,905	99.99	14,816,086	99.99	1,353,819	9.14
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,405	0.01	1,290	0.01	1,115	86.43
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,405	0.01	1,290	0.01	1,115	86.43
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	16,172,310	100.00	14,817,376	100.00	1,354,934	9.14

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。