

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)	604,871	1,603,980	2,208,851	12.74
(一)店頭市場(OTC)	604,871	280,198	885,069	5.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,323,782	1,323,782	7.63
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,500,394	7,407,869	14,908,263	85.97
(一)店頭市場(OTC)	7,500,394	7,401,826	14,902,220	85.93
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	6,043	6,043	0.04
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	194,250	19,913	214,163	1.23
(一)店頭市場(OTC)	145	217	362	0.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	194,105	19,696	213,801	1.23
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	8,863	8,863	0.05
(一)店頭市場(OTC)	-	6,682	6,682	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,181	2,181	0.01
小 計(一至四)	8,299,515	9,040,625	17,340,140	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,318	1,318	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	8,299,515	9,041,943	17,341,458	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9月	金 額	8,299,515	9,041,943	17,341,458
	比 重	47.86	52.14	100.00
111年8月	金 額	7,828,715	8,343,595	16,172,310
	比 重	48.41	51.59	100.00
比較增減	差 額	470,800	698,348	1,169,148
	變動率	6.01	8.37	7.23

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9月		111年8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)	2,208,851	12.74	1,838,304	11.37	370,547	20.16
(一)店頭市場(OTC)	885,069	5.11	704,358	4.36	180,711	25.66
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	852,503	4.92	620,172	3.84	232,331	37.46
3.買入選擇權(Bought Options)	14,698	0.09	36,217	0.22	-21,519	-59.42
4.賣出選擇權(Sold Options)	17,868	0.10	47,969	0.30	-30,101	-62.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,323,782	7.63	1,133,946	7.01	189,836	16.74
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	694,945	4.01	557,107	3.44	137,838	24.74
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	628,837	3.62	576,839	3.57	51,998	9.01
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)	14,908,263	85.97	14,212,258	87.88	696,005	4.90
(一)店頭市場(OTC)	14,902,220	85.93	14,207,525	87.85	694,695	4.89
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,677,679	9.67	1,432,338	8.86	245,341	17.13
2.換匯(Fx Swaps)	12,589,863	72.60	12,101,329	74.83	488,534	4.04
3.換匯換利(Currency Swaps)	76,222	0.44	40,965	0.25	35,257	86.07
4.買入選擇權(Bought Options)	276,718	1.60	317,238	1.96	-40,520	-12.77
5.賣出選擇權(Sold Options)	281,738	1.62	315,655	1.95	-33,917	-10.74
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,043	0.04	4,733	0.03	1,310	27.68
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	3,631	0.02	1,922	0.01	1,709	88.92
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,412	0.02	2,811	0.02	-399	-14.19
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)	214,163	1.23	109,278	0.68	104,885	95.98
(一)店頭市場(OTC)	362	0.00	606	0.01	-244	-40.26
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	213,801	1.23	108,672	0.67	105,129	96.74
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	8,863	0.05	10,065	0.06	-1,202	-11.94
(一)店頭市場(OTC)	6,682	0.04	8,921	0.05	-2,239	-25.10
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,181	0.01	1,144	0.01	1,037	90.65
小 計(一至四)	17,340,140	99.99	16,169,905	99.99	1,170,235	7.24
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,318	0.01	2,405	0.01	-1,087	-45.20
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,318	0.01	2,405	0.01	-1,087	-45.20
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	17,341,458	100.00	16,172,310	100.00	1,169,148	7.23

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。