

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

112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)	425,260	1,083,543	1,508,803	8.11
(一)店頭市場(OTC)	425,260	149,047	574,307	3.09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	934,496	934,496	5.02
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,209,590	9,776,758	16,986,348	91.27
(一)店頭市場(OTC)	7,209,590	9,774,495	16,984,085	91.26
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,263	2,263	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	82,216	16,371	98,587	0.53
(一)店頭市場(OTC)	45	4,357	4,402	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	82,171	12,014	94,185	0.51
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	12,927	12,927	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	8,103	8,103	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,824	4,824	0.03
小 計(一至四)	7,717,066	10,889,599	18,606,665	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3,460	3,460	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,717,066	10,893,059	18,610,125	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
112年8月	金 額	7,717,066	10,893,059	18,610,125
	比 重	41.47	58.53	100.00
112年7月	金 額	6,643,775	10,006,220	16,649,995
	比 重	39.90	60.10	100.00
比較增減	差 額	1,073,291	886,839	1,960,130
	變動率	16.15	8.86	11.77

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	112年8月		112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)	1,508,803	8.11	1,187,495	7.13	321,308	27.06
(一)店頭市場(OTC)	574,307	3.09	536,587	3.22	37,720	7.03
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	547,743	2.95	515,207	3.09	32,536	6.32
3.買入選擇權(Bought Options)	8,162	0.04	9,361	0.06	-1,199	-12.81
4.賣出選擇權(Sold Options)	18,402	0.10	12,019	0.07	6,383	53.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	934,496	5.02	650,908	3.91	283,588	43.57
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	462,486	2.49	300,487	1.81	161,999	53.91
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	470,189	2.53	350,386	2.10	119,803	34.19
3.買入選擇權(Bought Options)	893	0.00	35	0.00	858	2,451.43
4.賣出選擇權(Sold Options)	928	0.00	-	-	928	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	16,986,348	91.27	15,344,657	92.16	1,641,691	10.70
(一)店頭市場(OTC)	16,984,085	91.26	15,341,204	92.14	1,642,881	10.71
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,739,387	9.35	2,012,659	12.09	-273,272	-13.58
2.換匯(Fx Swaps)	14,422,990	77.50	12,634,581	75.88	1,788,409	14.15
3.換匯換利(Currency Swaps)	60,677	0.32	53,249	0.32	7,428	13.95
4.買入選擇權(Bought Options)	379,697	2.04	319,338	1.92	60,359	18.90
5.賣出選擇權(Sold Options)	381,334	2.05	321,377	1.93	59,957	18.66
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,263	0.01	3,453	0.02	-1,190	-34.46
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	986	0.00	1,727	0.01	-741	-42.91
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,277	0.01	1,726	0.01	-449	-26.01
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)	98,587	0.53	105,539	0.64	-6,952	-6.59
(一)店頭市場(OTC)	4,402	0.02	8,130	0.05	-3,728	-45.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	94,185	0.51	97,409	0.59	-3,224	-3.31
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	12,927	0.07	10,104	0.06	2,823	27.94
(一)店頭市場(OTC)	8,103	0.04	3,674	0.02	4,429	120.55
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,824	0.03	6,430	0.04	-1,606	-24.98
小 計(一至四)	18,606,665	99.98	16,647,795	99.99	1,958,870	11.77
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,460	0.02	2,200	0.01	1,260	57.27
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	3,460	0.02	2,200	0.01	1,260	57.27
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	18,610,125	100.00	16,649,995	100.00	1,960,130	11.77

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。