

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)	591,936	955,261	1,547,197	9.34
(一)店頭市場(OTC)	591,936	159,195	751,131	4.54
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	796,066	796,066	4.80
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,344,220	8,585,253	14,929,473	90.12
(一)店頭市場(OTC)	6,344,220	8,583,291	14,927,511	90.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,962	1,962	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	61,946	19,345	81,291	0.49
(一)店頭市場(OTC)	5	4,054	4,059	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	61,941	15,291	77,232	0.47
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	7,544	7,544	0.05
(一)店頭市場(OTC)	-	3,838	3,838	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,706	3,706	0.02
小 計(一至四)	6,998,102	9,567,403	16,565,505	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	806	806	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,998,102	9,568,209	16,566,311	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9月	金 額	6,998,102	9,568,209	16,566,311
	比 重	42.24	57.76	100.00
112年8月	金 額	7,717,066	10,893,059	18,610,125
	比 重	41.47	58.53	100.00
比較增減	差 額	-718,964	-1,324,850	-2,043,814
	變動率	-9.32	-12.16	-10.98

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9月		112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)	1,547,197	9.34	1,508,803	8.11	38,394	2.54
(一)店頭市場(OTC)	751,131	4.54	574,307	3.09	176,824	30.79
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	737,127	4.45	547,743	2.95	189,384	34.58
3.買入選擇權(Bought Options)	5,872	0.04	8,162	0.04	-2,290	-28.06
4.賣出選擇權(Sold Options)	8,132	0.05	18,402	0.10	-10,270	-55.81
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	796,066	4.80	934,496	5.02	-138,430	-14.81
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	393,204	2.37	462,486	2.49	-69,282	-14.98
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	402,862	2.43	470,189	2.53	-67,327	-14.32
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	893	0.00	-893	-100.00
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	928	0.00	-928	-100.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	14,929,473	90.12	16,986,348	91.27	-2,056,875	-12.11
(一)店頭市場(OTC)	14,927,511	90.11	16,984,085	91.26	-2,056,574	-12.11
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,552,599	9.37	1,739,387	9.35	-186,788	-10.74
2.換匯(Fx Swaps)	12,617,669	76.17	14,422,990	77.50	-1,805,321	-12.52
3.換匯換利(Currency Swaps)	38,555	0.23	60,677	0.32	-22,122	-36.46
4.買入選擇權(Bought Options)	360,517	2.18	379,697	2.04	-19,180	-5.05
5.賣出選擇權(Sold Options)	358,171	2.16	381,334	2.05	-23,163	-6.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,962	0.01	2,263	0.01	-301	-13.30
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	943	0.00	986	0.00	-43	-4.36
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,019	0.01	1,277	0.01	-258	-20.20
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)	81,291	0.49	98,587	0.53	-17,296	-17.54
(一)店頭市場(OTC)	4,059	0.02	4,402	0.02	-343	-7.79
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	77,232	0.47	94,185	0.51	-16,953	-18.00
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	7,544	0.05	12,927	0.07	-5,383	-41.64
(一)店頭市場(OTC)	3,838	0.03	8,103	0.04	-4,265	-52.63
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,706	0.02	4,824	0.03	-1,118	-23.18
小 計(一至四)	16,565,505	100.00	18,606,665	99.98	-2,041,160	-10.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	806	0.00	3,460	0.02	-2,654	-76.71
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	806	0.00	3,460	0.02	-2,654	-76.71
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	16,566,311	100.00	18,610,125	100.00	-2,043,814	-10.98

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。