

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商品種類別

113年6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)	1,219,044	1,392,023	2,611,067	13.10
(一)店頭市場(OTC)	1,219,044	174,983	1,394,027	6.99
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,217,040	1,217,040	6.11
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,174,389	11,050,063	17,224,452	86.44
(一)店頭市場(OTC)	6,174,389	11,045,807	17,220,196	86.42
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,256	4,256	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	54,546	21,006	75,552	0.38
(一)店頭市場(OTC)	80	7,671	7,751	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	54,466	13,335	67,801	0.34
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	13,688	13,688	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	7,473	7,473	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	6,215	6,215	0.03
小計(一至四)	7,447,979	12,476,780	19,924,759	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,776	2,776	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總計	7,447,979	12,479,556	19,927,535	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
113年6月	金額	7,447,979	12,479,556	19,927,535
	比重	37.38	62.62	100.00
113年5月	金額	7,216,980	14,341,910	21,558,890
	比重	33.48	66.52	100.00
比較增減	差額	230,999	-1,862,354	-1,631,355
	變動率	3.20	-12.99	-7.57

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	113年6月		113年5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)	2,611,067	13.10	2,289,152	10.62	321,915	14.06
(一)店頭市場(OTC)	1,394,027	6.99	969,343	4.50	424,684	43.81
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,375,482	6.90	937,128	4.35	438,354	46.78
3.買入選擇權(Bought Options)	10,317	0.05	13,615	0.06	-3,298	-24.22
4.賣出選擇權(Sold Options)	8,228	0.04	18,600	0.09	-10,372	-55.76
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,217,040	6.11	1,319,809	6.12	-102,769	-7.79
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	669,245	3.36	671,413	3.11	-2,168	-0.32
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	547,795	2.75	648,396	3.01	-100,601	-15.52
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)	17,224,452	86.44	19,154,726	88.85	-1,930,274	-10.08
(一)店頭市場(OTC)	17,220,196	86.42	19,150,988	88.83	-1,930,792	-10.08
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,452,433	7.29	1,882,493	8.73	-430,060	-22.85
2.換匯(Fx Swaps)	14,905,123	74.80	16,214,236	75.21	-1,309,113	-8.07
3.換匯換利(Currency Swaps)	42,942	0.22	36,709	0.17	6,233	16.98
4.買入選擇權(Bought Options)	406,672	2.04	500,731	2.32	-94,059	-18.78
5.賣出選擇權(Sold Options)	413,026	2.07	516,819	2.40	-103,793	-20.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,256	0.02	3,738	0.02	518	13.86
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,446	0.01	1,372	0.01	1,074	78.28
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,810	0.01	2,366	0.01	-556	-23.50
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)	75,552	0.38	99,641	0.46	-24,089	-24.18
(一)店頭市場(OTC)	7,751	0.04	6,031	0.03	1,720	28.52
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	67,801	0.34	93,610	0.43	-25,809	-27.57
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	13,688	0.07	13,833	0.06	-145	-1.05
(一)店頭市場(OTC)	7,473	0.04	8,358	0.04	-885	-10.59
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,215	0.03	5,475	0.02	740	13.52
小計(一至四)	19,924,759	99.99	21,557,352	99.99	-1,632,593	-7.57
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,776	0.01	1,538	0.01	1,238	80.49
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,776	0.01	1,538	0.01	1,238	80.49
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	19,927,535	100.00	21,558,890	100.00	-1,631,355	-7.57

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。