

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7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)	770,793	1,891,167	2,661,960	12.22
(一)店頭市場(OTC)	770,793	237,406	1,008,199	4.63
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,653,761	1,653,761	7.59
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,051,537	11,945,276	18,996,813	87.23
(一)店頭市場(OTC)	7,051,537	11,940,316	18,991,853	87.21
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,960	4,960	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	70,339	29,566	99,905	0.46
(一)店頭市場(OTC)	-	11,074	11,074	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	70,339	18,492	88,831	0.41
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	15,311	15,311	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	10,445	10,445	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,866	4,866	0.02
小 計(一至四)	7,892,669	13,881,320	21,773,989	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3,828	3,828	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,892,669	13,885,148	21,777,817	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7月	金 額	7,892,669	13,885,148	21,777,817
	比 重	36.24	63.76	100.00
113年6月	金 額	7,447,979	12,479,556	19,927,535
	比 重	37.38	62.62	100.00
比較增減	差 額	444,690	1,405,592	1,850,282
	變動率	5.97	11.26	9.29

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7月		113年6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)	2,661,960	12.22	2,611,067	13.10	50,893	1.95
(一)店頭市場(OTC)	1,008,199	4.63	1,394,027	6.99	-385,828	-27.68
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	970,627	4.46	1,375,482	6.90	-404,855	-29.43
3.買入選擇權(Bought Options)	13,938	0.06	10,317	0.05	3,621	35.10
4.賣出選擇權(Sold Options)	23,634	0.11	8,228	0.04	15,406	187.24
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,653,761	7.59	1,217,040	6.11	436,721	35.88
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	764,978	3.51	669,245	3.36	95,733	14.30
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	888,783	4.08	547,795	2.75	340,988	62.25
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)	18,996,813	87.23	17,224,452	86.44	1,772,361	10.29
(一)店頭市場(OTC)	18,991,853	87.21	17,220,196	86.42	1,771,657	10.29
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,826,630	8.39	1,452,433	7.29	374,197	25.76
2.換匯(Fx Swaps)	16,350,147	75.08	14,905,123	74.80	1,445,024	9.69
3.換匯換利(Currency Swaps)	75,043	0.34	42,942	0.22	32,101	74.75
4.買入選擇權(Bought Options)	363,099	1.67	406,672	2.04	-43,573	-10.71
5.賣出選擇權(Sold Options)	376,934	1.73	413,026	2.07	-36,092	-8.74
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,960	0.02	4,256	0.02	704	16.54
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,029	0.01	2,446	0.01	-417	-17.05
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,931	0.01	1,810	0.01	1,121	61.93
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)	99,905	0.46	75,552	0.38	24,353	32.23
(一)店頭市場(OTC)	11,074	0.05	7,751	0.04	3,323	42.87
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	88,831	0.41	67,801	0.34	21,030	31.02
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	15,311	0.07	13,688	0.07	1,623	11.86
(一)店頭市場(OTC)	10,445	0.05	7,473	0.04	2,972	39.77
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,866	0.02	6,215	0.03	-1,349	-21.71
小 計(一至四)	21,773,989	99.98	19,924,759	99.99	1,849,230	9.28
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,828	0.02	2,776	0.01	1,052	37.90
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	3,828	0.02	2,776	0.01	1,052	37.90
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	21,777,817	100.00	19,927,535	100.00	1,850,282	9.29

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。