

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)	1,315,797	1,584,274	2,900,071	12.93
(一)店頭市場(OTC)	1,315,797	299,850	1,615,647	7.20
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,284,424	1,284,424	5.73
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,337,313	13,066,389	19,403,702	86.52
(一)店頭市場(OTC)	6,337,313	13,063,525	19,400,838	86.51
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,864	2,864	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	77,661	32,162	109,823	0.49
(一)店頭市場(OTC)	93	3,477	3,570	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	77,568	28,685	106,253	0.47
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	10,242	10,242	0.05
(一)店頭市場(OTC)	-	7,846	7,846	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,396	2,396	0.01
小 計(一至四)	7,730,771	14,693,067	22,423,838	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,945	2,945	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,730,771	14,696,012	22,426,783	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8月	金 額	7,730,771	14,696,012	22,426,783
	比 重	34.47	65.53	100.00
113年7月	金 額	7,892,669	13,885,148	21,777,817
	比 重	36.24	63.76	100.00
比較增減	差 額	-161,898	810,864	648,966
	變動率	-2.05	5.84	2.98

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	113年8月		113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)	2,900,071	12.93	2,661,960	12.22	238,111	8.94
(一)店頭市場(OTC)	1,615,647	7.20	1,008,199	4.63	607,448	60.25
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,585,993	7.07	970,627	4.46	615,366	63.40
3.買入選擇權(Bought Options)	8,759	0.04	13,938	0.06	-5,179	-37.16
4.賣出選擇權(Sold Options)	20,895	0.09	23,634	0.11	-2,739	-11.59
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,284,424	5.73	1,653,761	7.59	-369,337	-22.33
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	678,801	3.03	764,978	3.51	-86,177	-11.27
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	605,623	2.70	888,783	4.08	-283,160	-31.86
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)	19,403,702	86.52	18,996,813	87.23	406,889	2.14
(一)店頭市場(OTC)	19,400,838	86.51	18,991,853	87.21	408,985	2.15
1.遠期契約(Outright Forwards)	2,158,687	9.63	1,826,630	8.39	332,057	18.18
2.換匯(Fx Swaps)	16,366,493	72.98	16,350,147	75.08	16,346	0.10
3.換匯換利(Currency Swaps)	62,891	0.28	75,043	0.34	-12,152	-16.19
4.買入選擇權(Bought Options)	414,912	1.85	363,099	1.67	51,813	14.27
5.賣出選擇權(Sold Options)	397,855	1.77	376,934	1.73	20,921	5.55
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,864	0.01	4,960	0.02	-2,096	-42.26
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,332	0.00	2,029	0.01	-697	-34.35
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,532	0.01	2,931	0.01	-1,399	-47.73
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)	109,823	0.49	99,905	0.46	9,918	9.93
(一)店頭市場(OTC)	3,570	0.02	11,074	0.05	-7,504	-67.76
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	106,253	0.47	88,831	0.41	17,422	19.61
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,242	0.05	15,311	0.07	-5,069	-33.11
(一)店頭市場(OTC)	7,846	0.04	10,445	0.05	-2,599	-24.88
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,396	0.01	4,866	0.02	-2,470	-50.76
小 計(一至四)	22,423,838	99.99	21,773,989	99.98	649,849	2.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,945	0.01	3,828	0.02	-883	-23.07
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,945	0.01	3,828	0.02	-883	-23.07
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	22,426,783	100.00	21,777,817	100.00	648,966	2.98

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。