

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)	1,490,437	1,373,159	2,863,596	12.85
(一)店頭市場(OTC)	1,490,437	353,757	1,844,194	8.27
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,019,402	1,019,402	4.58
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,367,427	12,957,877	19,325,304	86.70
(一)店頭市場(OTC)	6,367,427	12,954,352	19,321,779	86.68
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,525	3,525	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	57,646	25,005	82,651	0.37
(一)店頭市場(OTC)	19	4,022	4,041	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	57,627	20,983	78,610	0.35
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	14,785	14,785	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	12,089	12,089	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,696	2,696	0.01
小 計(一至四)	7,915,510	14,370,826	22,286,336	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3,534	3,534	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,915,510	14,374,360	22,289,870	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9月	金 額	7,915,510	14,374,360	22,289,870
	比 重	35.51	64.49	100.00
113年8月	金 額	r 7,730,812	14,696,012	r 22,426,824
	比 重	34.47	65.53	100.00
比較增減	差 額	184,698	-321,652	-136,954
	變動率	2.39	-2.19	-0.61

註：r為修正數。

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9月		113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)	2,863,596	12.85	2,900,071	12.93	-36,475	-1.26
(一)店頭市場(OTC)	1,844,194	8.27	1,615,647	7.20	228,547	14.15
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,815,036	8.14	1,585,993	7.07	229,043	14.44
3.買入選擇權(Bought Options)	7,009	0.03	8,759	0.04	-1,750	-19.98
4.賣出選擇權(Sold Options)	22,149	0.10	20,895	0.09	1,254	6.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,019,402	4.58	1,284,424	5.73	-265,022	-20.63
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	561,177	2.52	678,801	3.03	-117,624	-17.33
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	458,225	2.06	605,623	2.70	-147,398	-24.34
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)	19,325,304	86.70	19,403,702	86.52	-78,398	-0.40
(一)店頭市場(OTC)	19,321,779	86.68	19,400,838	86.51	-79,059	-0.41
1.遠期契約(Outright Forwards)	2,402,336	10.78	2,158,687	9.63	243,649	11.29
2.換匯(Fx Swaps)	15,902,181	71.34	16,366,493	72.98	-464,312	-2.84
3.換匯換利(Currency Swaps)	58,359	0.26	62,891	0.28	-4,532	-7.21
4.買入選擇權(Bought Options)	475,373	2.13	414,912	1.85	60,461	14.57
5.賣出選擇權(Sold Options)	483,530	2.17	397,855	1.77	85,675	21.53
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,525	0.02	2,864	0.01	661	23.08
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,844	0.01	1,332	0.00	512	38.44
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,681	0.01	1,532	0.01	149	9.73
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)	82,651	0.37	109,864	0.49	-27,213	-24.77
(一)店頭市場(OTC)	4,041	0.02	3,570	0.02	471	13.19
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	78,610	0.35	106,294	0.47	-27,684	-26.04
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	14,785	0.07	10,242	0.05	4,543	44.36
(一)店頭市場(OTC)	12,089	0.06	7,846	0.04	4,243	54.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,696	0.01	2,396	0.01	300	12.52
小 計(一至四)	22,286,336	99.99	22,423,879	99.99	-137,543	-0.61
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,534	0.01	2,945	0.01	589	20.00
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	3,534	0.01	2,945	0.01	589	20.00
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	22,289,870	100.00	22,426,824	100.00	-136,954	-0.61

註：1.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。

2. r為修正數。