

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10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)	1,198,089	1,168,000	2,366,089	10.72
(一)店頭市場(OTC)	1,198,089	322,801	1,520,890	6.89
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	845,199	845,199	3.83
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,640,657	12,977,568	19,618,225	88.89
(一)店頭市場(OTC)	6,640,657	12,974,575	19,615,232	88.88
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,993	2,993	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	46,710	27,224	73,934	0.34
(一)店頭市場(OTC)	-	4,999	4,999	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	46,710	22,225	68,935	0.31
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	9,362	9,362	0.04
(一)店頭市場(OTC)	-	6,914	6,914	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,448	2,448	0.01
小 計(一至四)	7,885,456	14,182,154	22,067,610	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	104	2,242	2,346	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,885,560	14,184,396	22,069,956	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10月	金 額	7,885,560	14,184,396	22,069,956
	比 重	35.73	64.27	100.00
113年9月	金 額	7,915,510	14,374,360	22,289,870
	比 重	35.51	64.49	100.00
比較增減	差 額	-29,950	-189,964	-219,914
	變動率	-0.38	-1.32	-0.99

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10月		113年9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)	2,366,089	10.72	2,863,596	12.85	-497,507	-17.37
(一)店頭市場(OTC)	1,520,890	6.89	1,844,194	8.27	-323,304	-17.53
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,496,370	6.78	1,815,036	8.14	-318,666	-17.56
3.買入選擇權(Bought Options)	7,175	0.03	7,009	0.03	166	2.37
4.賣出選擇權(Sold Options)	17,345	0.08	22,149	0.10	-4,804	-21.69
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	845,199	3.83	1,019,402	4.58	-174,203	-17.09
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	328,703	1.49	561,177	2.52	-232,474	-41.43
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	516,496	2.34	458,225	2.06	58,271	12.72
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)	19,618,225	88.89	19,325,304	86.70	292,921	1.52
(一)店頭市場(OTC)	19,615,232	88.88	19,321,779	86.68	293,453	1.52
1.遠期契約(Outright Forwards)	2,455,440	11.13	2,402,336	10.78	53,104	2.21
2.換匯(Fx Swaps)	16,137,897	73.12	15,902,181	71.34	235,716	1.48
3.換匯換利(Currency Swaps)	54,775	0.25	58,359	0.26	-3,584	-6.14
4.買入選擇權(Bought Options)	482,805	2.19	475,373	2.13	7,432	1.56
5.賣出選擇權(Sold Options)	484,315	2.19	483,530	2.17	785	0.16
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,993	0.01	3,525	0.02	-532	-15.09
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,656	0.01	1,844	0.01	-188	-10.20
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,337	0.00	1,681	0.01	-344	-20.46
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)	73,934	0.34	82,651	0.37	-8,717	-10.55
(一)店頭市場(OTC)	4,999	0.03	4,041	0.02	958	23.71
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	68,935	0.31	78,610	0.35	-9,675	-12.31
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	9,362	0.04	14,785	0.07	-5,423	-36.68
(一)店頭市場(OTC)	6,914	0.03	12,089	0.06	-5,175	-42.81
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,448	0.01	2,696	0.01	-248	-9.20
小 計(一至四)	22,067,610	99.99	22,286,336	99.99	-218,726	-0.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,346	0.01	3,534	0.01	-1,188	-33.62
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,242	0.01	3,534	0.01	-1,292	-36.56
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)	104	0.00	-	-	104	-
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	22,069,956	100.00	22,289,870	100.00	-219,914	-0.99

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。