

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

110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)	281,068	474,325	755,393	6.55
(一)店頭市場(OTC)	281,068	155,358	436,426	3.78
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	318,967	318,967	2.77
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,956,003	5,733,724	10,689,727	92.73
(一)店頭市場(OTC)	4,956,003	5,723,281	10,679,284	92.64
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	10,443	10,443	0.09
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	63,415	3,930	67,345	0.58
(一)店頭市場(OTC)	90	850	940	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	63,325	3,080	66,405	0.57
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	15,588	15,588	0.14
(一)店頭市場(OTC)	-	14,494	14,494	0.13
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,094	1,094	0.01
小 計(一至四)	5,300,486	6,227,567	11,528,053	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	279	279	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,300,486	6,227,846	11,528,332	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
110年6月	金 額	5,300,486	6,227,846	11,528,332
	比 重	45.98	54.02	100.00
110年5月	金 額	5,667,687	6,105,337	11,773,024
	比 重	48.14	51.86	100.00
比較增減	差 額	-367,201	122,509	-244,692
	變動率	-6.48	2.01	-2.08

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	110年6月		110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)	755,393	6.55	729,057	6.19	26,336	3.61
(一)店頭市場(OTC)	436,426	3.78	316,730	2.69	119,696	37.79
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	392,592	3.40	285,073	2.42	107,519	37.72
3.買入選擇權(Bought Options)	17,513	0.15	18,176	0.15	-663	-3.65
4.賣出選擇權(Sold Options)	26,321	0.23	13,481	0.12	12,840	95.25
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	318,967	2.77	412,327	3.50	-93,360	-22.64
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	164,568	1.43	200,626	1.70	-36,058	-17.97
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	154,399	1.34	211,424	1.80	-57,025	-26.97
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	277	0.00	-277	-100.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,689,727	92.73	10,810,955	91.83	-121,228	-1.12
(一)店頭市場(OTC)	10,679,284	92.64	10,788,776	91.64	-109,492	-1.01
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,150,359	9.98	1,139,337	9.68	11,022	0.97
2.換匯(Fx Swaps)	8,977,409	77.87	9,049,230	76.87	-71,821	-0.79
3.換匯換利(Currency Swaps)	66,684	0.58	57,944	0.49	8,740	15.08
4.買入選擇權(Bought Options)	245,566	2.13	273,720	2.32	-28,154	-10.29
5.賣出選擇權(Sold Options)	239,266	2.08	268,545	2.28	-29,279	-10.90
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	10,443	0.09	22,179	0.19	-11,736	-52.91
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	5,114	0.04	11,146	0.10	-6,032	-54.12
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	5,329	0.05	11,033	0.09	-5,704	-51.70
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)	67,345	0.58	221,342	1.88	-153,997	-69.57
(一)店頭市場(OTC)	940	0.01	802	0.01	138	17.21
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	66,405	0.57	220,540	1.87	-154,135	-69.89
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	15,588	0.14	10,702	0.09	4,886	45.66
(一)店頭市場(OTC)	14,494	0.13	7,045	0.06	7,449	105.73
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,094	0.01	3,657	0.03	-2,563	-70.08
小 計(一至四)	11,528,053	100.00	11,772,056	99.99	-244,003	-2.07
五、信用有關契約(Credit Contracts)	279	0.00	968	0.01	-689	-71.18
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	-	968	0.01	-968	-100.00
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)	279	0.00	-	-	279	-
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	11,528,332	100.00	11,773,024	100.00	-244,692	-2.08

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。