

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)	275,301	659,204	934,505	7.76
(一)店頭市場(OTC)	275,301	106,327	381,628	3.17
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	552,877	552,877	4.59
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,211,434	5,742,154	10,953,588	90.91
(一)店頭市場(OTC)	5,211,434	5,737,081	10,948,515	90.87
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	5,073	5,073	0.04
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	137,568	7,586	145,154	1.20
(一)店頭市場(OTC)	111	1,207	1,318	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	137,457	6,379	143,836	1.19
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	11,507	11,507	0.10
(一)店頭市場(OTC)	-	9,989	9,989	0.09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,518	1,518	0.01
小 計(一至四)	5,624,303	6,420,451	12,044,754	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	3,741	3,741	0.03
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,624,303	6,424,192	12,048,495	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7月	金 額	5,624,303	6,424,192	12,048,495
	比 重	46.68	53.32	100.00
110年6月	金 額	5,300,486	6,227,846	11,528,332
	比 重	45.98	54.02	100.00
比較增減	差 額	323,817	196,346	520,163
	變動率	6.11	3.15	4.51

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7月		110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)	934,505	7.76	755,393	6.55	179,112	23.71
(一)店頭市場(OTC)	381,628	3.17	436,426	3.78	-54,798	-12.56
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	340,657	2.83	392,592	3.40	-51,935	-13.23
3.買入選擇權(Bought Options)	21,565	0.18	17,513	0.15	4,052	23.14
4.賣出選擇權(Sold Options)	19,406	0.16	26,321	0.23	-6,915	-26.27
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	552,877	4.59	318,967	2.77	233,910	73.33
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	272,725	2.26	164,568	1.43	108,157	65.72
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	280,152	2.33	154,399	1.34	125,753	81.45
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)	10,953,588	90.91	10,689,727	92.73	263,861	2.47
(一)店頭市場(OTC)	10,948,515	90.87	10,679,284	92.64	269,231	2.52
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,201,327	9.97	1,150,359	9.98	50,968	4.43
2.換匯(Fx Swaps)	9,115,770	75.66	8,977,409	77.87	138,361	1.54
3.換匯換利(Currency Swaps)	79,569	0.66	66,684	0.58	12,885	19.32
4.買入選擇權(Bought Options)	279,250	2.32	245,566	2.13	33,684	13.72
5.賣出選擇權(Sold Options)	272,599	2.26	239,266	2.08	33,333	13.93
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,073	0.04	10,443	0.09	-5,370	-51.42
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,473	0.02	5,114	0.04	-2,641	-51.64
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,600	0.02	5,329	0.05	-2,729	-51.21
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)	145,154	1.20	67,345	0.58	77,809	115.54
(一)店頭市場(OTC)	1,318	0.01	940	0.01	378	40.21
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	143,836	1.19	66,405	0.57	77,431	116.60
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	11,507	0.10	15,588	0.14	-4,081	-26.18
(一)店頭市場(OTC)	9,989	0.09	14,494	0.13	-4,505	-31.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,518	0.01	1,094	0.01	424	38.76
小 計(一至四)	12,044,754	99.97	11,528,053	100.00	516,701	4.48
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,741	0.03	279	0.00	3,462	1240.86
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	3,461	0.03	-	-	3,461	-
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)	280	0.00	279	0.00	1	0.36
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	12,048,495	100.00	11,528,332	100.00	520,163	4.51

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。