

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)	217,943	754,017	971,960	7.72
(一)店頭市場(OTC)	217,943	210,495	428,438	3.40
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	543,522	543,522	4.32
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,126,052	6,331,541	11,457,593	90.97
(一)店頭市場(OTC)	5,126,052	6,325,535	11,451,587	90.92
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	6,006	6,006	0.05
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	146,322	8,287	154,609	1.23
(一)店頭市場(OTC)	136	1,335	1,471	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	146,186	6,952	153,138	1.22
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	10,713	10,713	0.08
(一)店頭市場(OTC)	-	7,349	7,349	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,364	3,364	0.02
小 計(一至四)	5,490,317	7,104,558	12,594,875	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	278	278	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,490,317	7,104,836	12,595,153	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8月	金 額	5,490,317	7,104,836	12,595,153
	比 重	43.59	56.41	100.00
110年7月	金 額	5,624,303	6,424,192	12,048,495
	比 重	46.68	53.32	100.00
比較增減	差 額	-133,986	680,644	546,658
	變動率	-2.38	10.60	4.54

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8月		110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)	971,960	7.72	934,505	7.76	37,455	4.01
(一)店頭市場(OTC)	428,438	3.40	381,628	3.17	46,810	12.27
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	379,466	3.01	340,657	2.83	38,809	11.39
3.買入選擇權(Bought Options)	23,673	0.19	21,565	0.18	2,108	9.78
4.賣出選擇權(Sold Options)	25,299	0.20	19,406	0.16	5,893	30.37
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	543,522	4.32	552,877	4.59	-9,355	-1.69
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	253,227	2.01	272,725	2.26	-19,498	-7.15
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	290,295	2.31	280,152	2.33	10,143	3.62
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)	11,457,593	90.97	10,953,588	90.91	504,005	4.60
(一)店頭市場(OTC)	11,451,587	90.92	10,948,515	90.87	503,072	4.59
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,226,360	9.74	1,201,327	9.97	25,033	2.08
2.換匯(Fx Swaps)	9,467,947	75.17	9,115,770	75.66	352,177	3.86
3.換匯換利(Currency Swaps)	115,870	0.92	79,569	0.66	36,301	45.62
4.買入選擇權(Bought Options)	325,562	2.58	279,250	2.32	46,312	16.58
5.賣出選擇權(Sold Options)	315,848	2.51	272,599	2.26	43,249	15.87
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,006	0.05	5,073	0.04	933	18.39
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	3,060	0.03	2,473	0.02	587	23.74
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,946	0.02	2,600	0.02	346	13.31
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)	154,609	1.23	145,154	1.20	9,455	6.51
(一)店頭市場(OTC)	1,471	0.01	1,318	0.01	153	11.61
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	153,138	1.22	143,836	1.19	9,302	6.47
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,713	0.08	11,507	0.10	-794	-6.90
(一)店頭市場(OTC)	7,349	0.06	9,989	0.09	-2,640	-26.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,364	0.02	1,518	0.01	1,846	121.61
小 計(一至四)	12,594,875	100.00	12,044,754	99.97	550,121	4.57
五、信用有關契約(Credit Contracts)	278	0.00	3,741	0.03	-3,463	-92.57
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	278	0.00	3,461	0.03	-3,183	-91.97
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	-280	-100.00
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	12,595,153	100.00	12,048,495	100.00	546,658	4.54

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。