

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商品種類別

112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)	448,783	964,075	1,412,858	7.95
(一)店頭市場(OTC)	448,783	319,967	768,750	4.33
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	644,108	644,108	3.62
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,460,998	9,774,651	16,235,649	91.35
(一)店頭市場(OTC)	6,460,998	9,771,393	16,232,391	91.33
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,258	3,258	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	83,163	28,836	111,999	0.63
(一)店頭市場(OTC)	-	8,668	8,668	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	83,163	20,168	103,331	0.58
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	10,571	10,571	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	3,315	3,315	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	7,256	7,256	0.04
小計(一至四)	6,992,944	10,778,133	17,771,077	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,739	1,739	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總計	6,992,944	10,779,872	17,772,816	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
112年6月	金額	6,992,944	10,779,872	17,772,816
	比重	39.35	60.65	100.00
112年5月	金額	7,192,686	10,749,222	17,941,908
	比重	40.09	59.91	100.00
比較增減	差額	-199,742	30,650	-169,092
	變動率	-2.78	0.29	-0.94

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	112年6月		112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)	1,412,858	7.95	1,837,840	10.24	-424,982	-23.12
(一)店頭市場(OTC)	768,750	4.33	861,533	4.80	-92,783	-10.77
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	711,679	4.00	828,932	4.62	-117,253	-14.15
3.買入選擇權(Bought Options)	16,981	0.10	13,714	0.08	3,267	23.82
4.賣出選擇權(Sold Options)	40,090	0.23	18,887	0.10	21,203	112.26
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	644,108	3.62	976,307	5.44	-332,199	-34.03
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	324,763	1.83	509,303	2.84	-184,540	-36.23
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	319,345	1.79	467,004	2.60	-147,659	-31.62
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)	16,235,649	91.35	15,965,920	88.99	269,729	1.69
(一)店頭市場(OTC)	16,232,391	91.33	15,963,430	88.97	268,961	1.68
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,876,966	10.56	1,886,590	10.51	-9,624	-0.51
2.換匯(Fx Swaps)	13,704,797	77.11	13,413,073	74.76	291,724	2.17
3.換匯換利(Currency Swaps)	32,359	0.18	29,517	0.17	2,842	9.63
4.買入選擇權(Bought Options)	310,172	1.75	313,078	1.74	-2,906	-0.93
5.賣出選擇權(Sold Options)	308,097	1.73	321,172	1.79	-13,075	-4.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,258	0.02	2,490	0.02	768	30.84
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,326	0.01	1,233	0.01	93	7.54
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,932	0.01	1,257	0.01	675	53.70
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)	111,999	0.63	125,443	0.70	-13,444	-10.72
(一)店頭市場(OTC)	8,668	0.05	4,514	0.03	4,154	92.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	103,331	0.58	120,929	0.67	-17,598	-14.55
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,571	0.06	11,167	0.06	-596	-5.34
(一)店頭市場(OTC)	3,315	0.02	3,977	0.02	-662	-16.65
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,256	0.04	7,190	0.04	66	0.92
小計(一至四)	17,771,077	99.99	17,940,370	99.99	-169,293	-0.94
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,739	0.01	1,538	0.01	201	13.07
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,739	0.01	1,538	0.01	201	13.07
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	17,772,816	100.00	17,941,908	100.00	-169,092	-0.94

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。