

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)	321,798	865,697	1,187,495	7.13
(一)店頭市場(OTC)	321,798	214,789	536,587	3.22
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	650,908	650,908	3.91
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,233,449	9,111,208	15,344,657	92.16
(一)店頭市場(OTC)	6,233,449	9,107,755	15,341,204	92.14
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,453	3,453	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	88,528	17,011	105,539	0.64
(一)店頭市場(OTC)	30	8,100	8,130	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	88,498	8,911	97,409	0.59
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	10,104	10,104	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	3,674	3,674	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	6,430	6,430	0.04
小 計(一至四)	6,643,775	10,004,020	16,647,795	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,200	2,200	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,643,775	10,006,220	16,649,995	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7月	金 額	6,643,775	10,006,220	16,649,995
	比 重	39.90	60.10	100.00
112年6月	金 額	6,992,944	10,779,872	17,772,816
	比 重	39.35	60.65	100.00
比較增減	差 額	-349,169	-773,652	-1,122,821
	變動率	-4.99	-7.18	-6.32

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7月		112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)	1,187,495	7.13	1,412,858	7.95	-225,363	-15.95
(一)店頭市場(OTC)	536,587	3.22	768,750	4.33	-232,163	-30.20
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	515,207	3.09	711,679	4.00	-196,472	-27.61
3.買入選擇權(Bought Options)	9,361	0.06	16,981	0.10	-7,620	-44.87
4.賣出選擇權(Sold Options)	12,019	0.07	40,090	0.23	-28,071	-70.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	650,908	3.91	644,108	3.62	6,800	1.06
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	300,487	1.81	324,763	1.83	-24,276	-7.47
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	350,386	2.10	319,345	1.79	31,041	9.72
3.買入選擇權(Bought Options)	35	0.00	-	-	35	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	15,344,657	92.16	16,235,649	91.35	-890,992	-5.49
(一)店頭市場(OTC)	15,341,204	92.14	16,232,391	91.33	-891,187	-5.49
1.遠期契約(Outright Forwards)	2,012,659	12.09	1,876,966	10.56	135,693	7.23
2.換匯(Fx Swaps)	12,634,581	75.88	13,704,797	77.11	-1,070,216	-7.81
3.換匯換利(Currency Swaps)	53,249	0.32	32,359	0.18	20,890	64.56
4.買入選擇權(Bought Options)	319,338	1.92	310,172	1.75	9,166	2.96
5.賣出選擇權(Sold Options)	321,377	1.93	308,097	1.73	13,280	4.31
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,453	0.02	3,258	0.02	195	5.99
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,727	0.01	1,326	0.01	401	30.24
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,726	0.01	1,932	0.01	-206	-10.66
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)	105,539	0.64	111,999	0.63	-6,460	-5.77
(一)店頭市場(OTC)	8,130	0.05	8,668	0.05	-538	-6.21
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	97,409	0.59	103,331	0.58	-5,922	-5.73
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,104	0.06	10,571	0.06	-467	-4.42
(一)店頭市場(OTC)	3,674	0.02	3,315	0.02	359	10.83
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,430	0.04	7,256	0.04	-826	-11.38
小 計(一至四)	16,647,795	99.99	17,771,077	99.99	-1,123,282	-6.32
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,200	0.01	1,739	0.01	461	26.51
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,200	0.01	1,739	0.01	461	26.51
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	16,649,995	100.00	17,772,816	100.00	-1,122,821	-6.32

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。