

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

114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)	1,261,510	1,140,171	2,401,681	11.93
(一)店頭市場(OTC)	1,261,510	207,828	1,469,338	7.30
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	932,343	932,343	4.63
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,206,241	12,435,199	17,641,440	87.62
(一)店頭市場(OTC)	5,206,241	12,430,352	17,636,593	87.60
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,847	4,847	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	54,218	19,886	74,104	0.37
(一)店頭市場(OTC)	75	7,018	7,093	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	54,143	12,868	67,011	0.33
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	15,535	15,535	0.08
(一)店頭市場(OTC)	-	9,938	9,938	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	5,597	5,597	0.03
小 計(一至四)	6,521,969	13,610,791	20,132,760	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	-	-	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,521,969	13,610,791	20,132,760	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
114年6月	金 額	6,521,969	13,610,791	20,132,760
	比 重	32.39	67.61	100.00
114年5月	金 額	6,803,222	12,870,468	19,673,690
	比 重	34.58	65.42	100.00
比較增減	差 額	-281,253	740,323	459,070
	變 動 率	-4.13	5.75	2.33

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	114年6月		114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)	2,401,681	11.93	2,134,091	10.85	267,590	12.54
(一)店頭市場(OTC)	1,469,338	7.30	1,336,674	6.80	132,664	9.92
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,433,865	7.12	1,310,416	6.66	123,449	9.42
3.買入選擇權(Bought Options)	12,801	0.07	13,624	0.07	-823	-6.04
4.賣出選擇權(Sold Options)	22,672	0.11	12,634	0.07	10,038	79.45
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	932,343	4.63	797,417	4.05	134,926	16.92
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	480,473	2.39	410,090	2.08	70,383	17.16
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	451,870	2.24	387,327	1.97	64,543	16.66
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)	17,641,440	87.62	17,441,516	88.66	199,924	1.15
(一)店頭市場(OTC)	17,636,593	87.60	17,436,689	88.63	199,904	1.15
1.遠期契約(Outright Forwards)	2,025,914	10.06	1,904,413	9.68	121,501	6.38
2.換匯(Fx Swaps)	14,719,599	73.11	14,835,444	75.41	-115,845	-0.78
3.換匯換利(Currency Swaps)	49,820	0.25	41,975	0.21	7,845	18.69
4.買入選擇權(Bought Options)	419,846	2.09	322,506	1.64	97,340	30.18
5.賣出選擇權(Sold Options)	421,414	2.09	332,351	1.69	89,063	26.80
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,847	0.02	4,827	0.03	20	0.41
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,318	0.01	2,726	0.02	-408	-14.97
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,529	0.01	2,101	0.01	428	20.37
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)	74,104	0.37	78,797	0.40	-4,693	-5.96
(一)店頭市場(OTC)	7,093	0.04	4,061	0.02	3,032	74.66
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	67,011	0.33	74,736	0.38	-7,725	-10.34
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	15,535	0.08	16,602	0.08	-1,067	-6.43
(一)店頭市場(OTC)	9,938	0.05	10,809	0.05	-871	-8.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,597	0.03	5,793	0.03	-196	-3.38
小計(一至四)	20,132,760	100.00	19,671,006	99.99	461,754	2.35
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	-	2,684	0.01	-2,684	-100.00
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	-	150	0.00	-150	-100
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)	-	-	2,534	0.01	-2,534	-100
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	20,132,760	100.00	19,673,690	100.00	459,070	2.33

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。