

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)	1,170,942	1,467,624	2,638,566	11.35
(一)店頭市場(OTC)	1,170,942	249,742	1,420,684	6.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,217,882	1,217,882	5.24
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,109,904	14,385,181	20,495,085	88.18
(一)店頭市場(OTC)	6,109,904	14,355,150	20,465,054	88.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	30,031	30,031	0.13
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	63,195	29,386	92,581	0.40
(一)店頭市場(OTC)	242	8,497	8,739	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	62,953	20,889	83,842	0.36
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	14,893	14,893	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	10,829	10,829	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,064	4,064	0.02
小 計(一至四)	7,344,041	15,897,084	23,241,125	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	-	-	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,344,041	15,897,084	23,241,125	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7月	金 額	7,344,041	15,897,084	23,241,125
	比 重	31.60	68.40	100.00
114年6月	金 額	6,521,969	13,610,791	20,132,760
	比 重	32.39	67.61	100.00
比較增減	差 額	822,072	2,286,293	3,108,365
	變動率	12.60	16.80	15.44

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7月		114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)	2,638,566	11.35	2,401,681	11.93	236,885	9.86
(一)店頭市場(OTC)	1,420,684	6.11	1,469,338	7.30	-48,654	-3.31
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,382,352	5.95	1,433,865	7.12	-51,513	-3.59
3.買入選擇權(Bought Options)	19,214	0.08	12,801	0.07	6,413	50.10
4.賣出選擇權(Sold Options)	19,118	0.08	22,672	0.11	-3,554	-15.68
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,217,882	5.24	932,343	4.63	285,539	30.63
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	652,896	2.81	480,473	2.39	172,423	35.89
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	564,986	2.43	451,870	2.24	113,116	25.03
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)	20,495,085	88.18	17,641,440	87.62	2,853,645	16.18
(一)店頭市場(OTC)	20,465,054	88.05	17,636,593	87.60	2,828,461	16.04
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,870,527	8.05	2,025,914	10.06	-155,387	-7.67
2.換匯(Fx Swaps)	17,668,472	76.02	14,719,599	73.11	2,948,873	20.03
3.換匯換利(Currency Swaps)	66,399	0.29	49,820	0.25	16,579	33.28
4.買入選擇權(Bought Options)	421,471	1.81	419,846	2.09	1,625	0.39
5.賣出選擇權(Sold Options)	438,185	1.88	421,414	2.09	16,771	3.98
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	30,031	0.13	4,847	0.02	25,184	519.58
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	14,735	0.06	2,318	0.01	12,417	535.68
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	15,296	0.07	2,529	0.01	12,767	504.82
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)	92,581	0.40	74,104	0.37	18,477	24.93
(一)店頭市場(OTC)	8,739	0.04	7,093	0.04	1,646	23.21
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	83,842	0.36	67,011	0.33	16,831	25.12
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	14,893	0.07	15,535	0.08	-642	-4.13
(一)店頭市場(OTC)	10,829	0.05	9,938	0.05	891	8.97
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,064	0.02	5,597	0.03	-1,533	-27.39
小 計(一至四)	23,241,125	100.00	20,132,760	100.00	3,108,365	15.44
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	-	-	-	-	-
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	-	-	-	-	-
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	23,241,125	100.00	20,132,760	100.00	3,108,365	15.44

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。