

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)	1,151,696	1,295,669	2,447,365	10.61
(一)店頭市場(OTC)	1,151,696	381,121	1,532,817	6.64
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	914,548	914,548	3.97
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,577,825	14,948,613	20,526,438	88.95
(一)店頭市場(OTC)	5,577,825	14,943,903	20,521,728	88.93
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,710	4,710	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	56,705	34,372	91,077	0.39
(一)店頭市場(OTC)	175	12,272	12,447	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	56,530	22,100	78,630	0.34
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	11,325	11,325	0.05
(一)店頭市場(OTC)	-	8,860	8,860	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,465	2,465	0.01
小 計(一至四)	6,786,226	16,289,979	23,076,205	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	529	529	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,786,226	16,290,508	23,076,734	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8月	金 額	6,786,226	16,290,508	23,076,734
	比 重	29.41	70.59	100.00
114年7月	金 額	7,344,041	15,897,084	23,241,125
	比 重	31.60	68.40	100.00
比較增減	差 額	-557,815	393,424	-164,391
	變動率	-7.60	2.47	-0.71

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8月		114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)	2,447,365	10.61	2,638,566	11.35	-191,201	-7.25
(一)店頭市場(OTC)	1,532,817	6.64	1,420,684	6.11	112,133	7.89
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,497,308	6.49	1,382,352	5.95	114,956	8.32
3.買入選擇權(Bought Options)	17,611	0.07	19,214	0.08	-1,603	-8.34
4.賣出選擇權(Sold Options)	17,898	0.08	19,118	0.08	-1,220	-6.38
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	914,548	3.97	1,217,882	5.24	-303,334	-24.91
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	422,641	1.83	652,896	2.81	-230,255	-35.27
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	491,876	2.14	564,986	2.43	-73,110	-12.94
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	31	-	-	-	31	-
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	20,526,438	88.95	20,495,085	88.18	31,353	0.15
(一)店頭市場(OTC)	20,521,728	88.93	20,465,054	88.05	56,674	0.28
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,562,159	6.78	1,870,527	8.05	-308,368	-16.49
2.換匯(Fx Swaps)	17,977,553	77.90	17,668,472	76.02	309,081	1.75
3.換匯換利(Currency Swaps)	81,498	0.35	66,399	0.29	15,099	22.74
4.買入選擇權(Bought Options)	450,066	1.95	421,471	1.81	28,595	6.78
5.賣出選擇權(Sold Options)	450,452	1.95	438,185	1.88	12,267	2.80
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,710	0.02	30,031	0.13	-25,321	-84.32
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,759	0.01	14,735	0.06	-11,976	-81.28
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,951	0.01	15,296	0.07	-13,345	-87.25
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)	91,077	0.39	92,581	0.40	-1,504	-1.62
(一)店頭市場(OTC)	12,447	0.05	8,739	0.04	3,708	42.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	78,630	0.34	83,842	0.36	-5,212	-6.22
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	11,325	0.05	14,893	0.07	-3,568	-23.96
(一)店頭市場(OTC)	8,860	0.04	10,829	0.05	-1,969	-18.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,465	0.01	4,064	0.02	-1,599	-39.35
小 計(一至四)	23,076,205	100.00	23,241,125	100.00	-164,920	-0.71
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	529	0.00	-	-	529	-
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	306	0.00	-	-	306	-
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)	223	0.00	-	-	223	-
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	23,076,734	100.00	23,241,125	100.00	-164,391	-0.71

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。