

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9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)	1,259,271	1,455,886	2,715,157	11.10
(一)店頭市場(OTC)	1,259,271	509,599	1,768,870	7.23
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	946,287	946,287	3.87
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,153,044	15,489,699	21,642,743	88.50
(一)店頭市場(OTC)	6,153,044	15,485,349	21,638,393	88.48
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,350	4,350	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	48,393	35,688	84,081	0.34
(一)店頭市場(OTC)	328	11,208	11,536	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	48,065	24,480	72,545	0.29
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	14,278	14,278	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	6,799	6,799	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	7,479	7,479	0.03
小 計(一至四)	7,460,708	16,995,551	24,456,259	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	305	305	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,460,708	16,995,856	24,456,564	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9月	金 額	7,460,708	16,995,856	24,456,564
	比 重	30.51	69.49	100.00
114年8月	金 額	6,786,226	16,290,508	23,076,734
	比 重	29.41	70.59	100.00
比較增減	差 額	674,482	705,348	1,379,830
	變動率	9.94	4.33	5.98

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9月		114年8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)	2,715,157	11.10	2,447,365	10.61	267,792	10.94
(一)店頭市場(OTC)	1,768,870	7.23	1,532,817	6.64	236,053	15.40
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,715,538	7.01	1,497,308	6.49	218,230	14.57
3.買入選擇權(Bought Options)	24,309	0.10	17,611	0.07	6,698	38.03
4.賣出選擇權(Sold Options)	29,023	0.12	17,898	0.08	11,125	62.16
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	946,287	3.87	914,548	3.97	31,739	3.47
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	501,078	2.05	422,641	1.83	78,437	18.56
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	445,209	1.82	491,876	2.14	-46,667	-9.49
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	31	0.00	-31	-100.00
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	21,642,743	88.50	20,526,438	88.95	1,116,305	5.44
(一)店頭市場(OTC)	21,638,393	88.48	20,521,728	88.93	1,116,665	5.44
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,921,879	7.86	1,562,159	6.78	359,720	23.03
2.換匯(Fx Swaps)	18,841,697	77.04	17,977,553	77.90	864,144	4.81
3.換匯換利(Currency Swaps)	54,608	0.22	81,498	0.35	-26,890	-32.99
4.買入選擇權(Bought Options)	407,080	1.67	450,066	1.95	-42,986	-9.55
5.賣出選擇權(Sold Options)	413,129	1.69	450,452	1.95	-37,323	-8.29
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,350	0.02	4,710	0.02	-360	-7.64
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,326	0.01	2,759	0.01	-433	-15.69
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,024	0.01	1,951	0.01	73	3.74
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)	84,081	0.34	91,077	0.39	-6,996	-7.68
(一)店頭市場(OTC)	11,536	0.05	12,447	0.05	-911	-7.32
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	72,545	0.29	78,630	0.34	-6,085	-7.74
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	14,278	0.06	11,325	0.05	2,953	26.08
(一)店頭市場(OTC)	6,799	0.03	8,860	0.04	-2,061	-23.26
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,479	0.03	2,465	0.01	5,014	203.41
小 計(一至四)	24,456,259	100.00	23,076,205	100.00	1,380,054	5.98
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	305	0.00	529	0.00	-224	-42.34
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	305	0.00	306	0.00	-1	-0.33
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	-100.00
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	24,456,564	100.00	23,076,734	100.00	1,379,830	5.98

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。