

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10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)	1,195,372	1,322,255	2,517,627	11.55
(一)店頭市場(OTC)	1,195,372	537,323	1,732,695	7.95
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	784,932	784,932	3.60
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,907,474	13,243,177	19,150,651	87.83
(一)店頭市場(OTC)	5,907,474	13,239,265	19,146,739	87.82
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,912	3,912	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	69,576	34,928	104,504	0.48
(一)店頭市場(OTC)	100	13,604	13,704	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	69,476	21,324	90,800	0.42
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	28,413	28,413	0.13
(一)店頭市場(OTC)	-	12,222	12,222	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	16,191	16,191	0.07
小 計(一至四)	7,172,422	14,628,773	21,801,195	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,247	1,247	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,172,422	14,630,020	21,802,442	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10月	金 額	7,172,422	14,630,020	21,802,442
	比 重	32.90	67.10	100.00
114年9月	金 額	7,460,708	16,995,856	24,456,564
	比 重	30.51	69.49	100.00
比較增減	差 額	-288,286	-2,365,836	-2,654,122
	變動率	-3.86	-13.92	-10.85

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10月		114年9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)	2,517,627	11.55	2,715,157	11.10	-197,530	-7.28
(一)店頭市場(OTC)	1,732,695	7.95	1,768,870	7.23	-36,175	-2.05
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,682,611	7.72	1,715,538	7.01	-32,927	-1.92
3.買入選擇權(Bought Options)	15,121	0.07	24,309	0.10	-9,188	-37.80
4.賣出選擇權(Sold Options)	34,963	0.16	29,023	0.12	5,940	20.47
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	784,932	3.60	946,287	3.87	-161,355	-17.05
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	392,575	1.80	501,078	2.05	-108,503	-21.65
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	392,357	1.80	445,209	1.82	-52,852	-11.87
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)	19,150,651	87.83	21,642,743	88.50	-2,492,092	-11.51
(一)店頭市場(OTC)	19,146,739	87.82	21,638,393	88.48	-2,491,654	-11.51
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,700,641	7.80	1,921,879	7.86	-221,238	-11.51
2.換匯(Fx Swaps)	16,575,466	76.03	18,841,697	77.04	-2,266,231	-12.03
3.換匯換利(Currency Swaps)	28,442	0.13	54,608	0.22	-26,166	-47.92
4.買入選擇權(Bought Options)	411,809	1.89	407,080	1.67	4,729	1.16
5.賣出選擇權(Sold Options)	430,381	1.97	413,129	1.69	17,252	4.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,912	0.01	4,350	0.02	-438	-10.07
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,413	0.00	2,326	0.01	-913	-39.25
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,499	0.01	2,024	0.01	475	23.47
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)	104,504	0.48	84,081	0.34	20,423	24.29
(一)店頭市場(OTC)	13,704	0.06	11,536	0.05	2,168	18.79
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	90,800	0.42	72,545	0.29	18,255	25.16
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	28,413	0.13	14,278	0.06	14,135	99.00
(一)店頭市場(OTC)	12,222	0.06	6,799	0.03	5,423	79.76
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	16,191	0.07	7,479	0.03	8,712	116.49
小 計(一至四)	21,801,195	99.99	24,456,259	100.00	-2,655,064	-10.86
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	1,247	0.01	305	0.00	942	308.85
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,247	0.01	305	0.00	942	308.85
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	21,802,442	100.00	24,456,564	100.00	-2,654,122	-10.85

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。