

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

115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)	2,541,217	1,387,934	3,929,151	15.07
(一)店頭市場(OTC)	2,541,217	655,516	3,196,733	12.26
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	732,418	732,418	2.81
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Contracts)	7,890,280	13,920,193	21,810,473	83.67
(一)店頭市場(OTC)	7,890,280	13,914,992	21,805,272	83.65
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	5,201	5,201	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-Linked Contracts)	242,159	53,647	295,806	1.14
(一)店頭市場(OTC)	598	19,226	19,824	0.08
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	241,561	34,421	275,982	1.06
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	18,558	18,558	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	11,833	11,833	0.04
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	6,725	6,725	0.03
小 計(一至四)	10,673,656	15,380,332	26,053,988	99.95
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	11,813	11,813	0.05
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	10,673,656	15,392,145	26,065,801	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
115年6月	金 額	10,673,656	15,392,145	26,065,801
	比 重	40.95	59.05	100.00
115年5月	金 額	9,183,632	12,452,153	21,635,785
	比 重	42.45	57.55	100.00
比較增減	差 額	1,490,024	2,939,992	4,430,016
	變動率	16.22	23.61	20.48

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	115年6月		115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)	3,929,151	15.07	3,597,534	16.63	331,617	9.22
(一)店頭市場(OTC)	3,196,733	12.26	2,500,782	11.56	695,951	27.83
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	3,012,837	11.56	2,323,041	10.74	689,796	29.69
3.買入選擇權(Bought Options)	89,402	0.34	129,118	0.60	-39,716	-30.76
4.賣出選擇權(Sold Options)	94,494	0.36	48,623	0.22	45,871	94.34
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	732,418	2.81	1,096,752	5.07	-364,334	-33.22
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	381,754	1.46	532,478	2.46	-150,724	-28.31
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	350,664	1.35	564,274	2.61	-213,610	-37.86
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 Contracts)	21,810,473	83.67	17,780,560	82.18	4,029,913	22.66
(一)店頭市場(OTC)	21,805,272	83.65	17,774,329	82.15	4,030,943	22.68
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,261,895	4.84	1,044,448	4.83	217,447	20.82
2.換匯(FX Swaps)	19,372,523	74.32	15,657,285	72.37	3,715,238	23.73
3.換匯換利(Currency Swaps)	62,325	0.24	53,780	0.25	8,545	15.89
4.買入選擇權(Bought Options)	550,035	2.11	502,335	2.32	47,700	9.50
5.賣出選擇權(Sold Options)	558,494	2.14	516,481	2.38	42,013	8.13
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	5,201	0.02	6,231	0.03	-1,030	-16.53
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,628	0.01	2,243	0.01	385	17.16
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,573	0.01	3,988	0.02	-1,415	-35.48
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)	295,806	1.14	232,814	1.08	62,992	27.06
(一)店頭市場(OTC)	19,824	0.08	21,810	0.10	-1,986	-9.11
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	275,982	1.06	211,004	0.98	64,978	30.79
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	18,558	0.07	20,388	0.09	-1,830	-8.98
(一)店頭市場(OTC)	11,833	0.04	11,259	0.05	574	5.10
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	6,725	0.03	9,129	0.04	-2,404	-26.33
小 計(一至四)	26,053,988	99.95	21,631,296	99.98	4,422,692	20.45
五、信用有關契約(Credit Contracts)	11,813	0.05	4,489	0.02	7,324	163.15
1.信用違約交換(Credit Default Swaps)	11,813	0.05	4,489	0.02	7,324	163.15
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(Others)	-	-	-	-	-	-
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	26,065,801	100.00	21,635,785	100.00	4,430,016	20.48

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。