

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)	1,503,784	1,330,314	2,834,098	11.72
(一)店頭市場(OTC)	1,503,784	655,544	2,159,328	8.93
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	674,770	674,770	2.79
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Contracts)	8,368,234	12,674,809	21,043,043	87.08
(一)店頭市場(OTC)	8,368,234	12,670,532	21,038,766	87.06
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	4,277	4,277	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-Linked Contracts)	203,409	54,938	258,347	1.07
(一)店頭市場(OTC)	1,102	12,555	13,657	0.06
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	202,307	42,383	244,690	1.01
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	23,958	23,958	0.10
(一)店頭市場(OTC)	-	10,634	10,634	0.04
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	13,324	13,324	0.06
小 計(一至四)	10,075,427	14,084,019	24,159,446	99.97
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	6,210	6,210	0.03
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	10,075,427	14,090,229	24,165,656	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7月	金 額	10,075,427	14,090,229	24,165,656
	比 重	41.69	58.31	100.00
115年6月	金 額	10,673,656	15,392,145	26,065,801
	比 重	40.95	59.05	100.00
比較增減	差 額	-598,229	-1,301,916	-1,900,145
	變動率	-5.60	-8.46	-7.29

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7月		115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)	2,834,098	11.72	3,929,151	15.07	-1,095,053	-27.87
(一)店頭市場(OTC)	2,159,328	8.93	3,196,733	12.26	-1,037,405	-32.45
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	2,008,776	8.31	3,012,837	11.56	-1,004,061	-33.33
3.買入選擇權(Bought Options)	123,131	0.51	89,402	0.34	33,729	37.73
4.賣出選擇權(Sold Options)	27,421	0.11	94,494	0.36	-67,073	-70.98
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	674,770	2.79	732,418	2.81	-57,648	-7.87
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	313,001	1.29	381,754	1.46	-68,753	-18.01
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	361,769	1.50	350,664	1.35	11,105	3.17
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)	21,043,043	87.08	21,810,473	83.67	-767,430	-3.52
(一)店頭市場(OTC)	21,038,766	87.06	21,805,272	83.65	-766,506	-3.52
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,195,489	4.95	1,261,895	4.84	-66,406	-5.26
2.換匯(FX Swaps)	18,607,536	77.00	19,372,523	74.32	-764,987	-3.95
3.換匯換利(Currency Swaps)	78,123	0.32	62,325	0.24	15,798	25.35
4.買入選擇權(Bought Options)	582,250	2.41	550,035	2.11	32,215	5.86
5.賣出選擇權(Sold Options)	575,368	2.38	558,494	2.14	16,874	3.02
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	4,277	0.02	5,201	0.02	-924	-17.77
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,811	0.01	2,628	0.01	-817	-31.09
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,466	0.01	2,573	0.01	-107	-4.16
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)	258,347	1.07	295,806	1.14	-37,459	-12.66
(一)店頭市場(OTC)	13,657	0.06	19,824	0.08	-6,167	-31.11
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	244,690	1.01	275,982	1.06	-31,292	-11.34
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	23,958	0.10	18,558	0.07	5,400	29.10
(一)店頭市場(OTC)	10,634	0.04	11,833	0.04	-1,199	-10.13
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	13,324	0.06	6,725	0.03	6,599	98.13
小 計(一至四)	24,159,446	99.97	26,053,988	99.95	-1,894,542	-7.27
五、信用有關契約(Credit Contracts)	6,210	0.03	11,813	0.05	-5,603	-47.43
1.信用違約交換(Credit Default Swaps)	6,210	0.03	11,813	0.05	-5,603	-47.43
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	24,165,656	100.00	26,065,801	100.00	-1,900,145	-7.29

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。