

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)	1,099,916	1,009,815	2,109,731	9.88
(一)店頭市場(OTC)	1,099,916	406,236	1,506,152	7.05
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	603,579	603,579	2.83
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Contracts)	7,306,830	11,707,066	19,013,896	89.06
(一)店頭市場(OTC)	7,306,830	11,702,282	19,009,112	89.04
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	4,784	4,784	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-Linked Contracts)	154,455	45,127	199,582	0.93
(一)店頭市場(OTC)	857	17,381	18,238	0.08
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	153,598	27,746	181,344	0.85
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	26,376	26,376	0.12
(一)店頭市場(OTC)	-	8,993	8,993	0.04
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	17,383	17,383	0.08
小 計(一至四)	8,561,201	12,788,384	21,349,585	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	995	165	1,160	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	8,562,196	12,788,549	21,350,745	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8月	金 額	8,562,196	12,788,549	21,350,745
	比 重	40.10	59.90	100.00
115年7月	金 額	10,075,427	14,090,229	24,165,656
	比 重	41.69	58.31	100.00
比較增減	差 額	-1,513,231	-1,301,680	-2,814,911
	變動率	-15.02	-9.24	-11.65

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8月		115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)	2,109,731	9.88	2,834,098	11.72	-724,367	-25.56
(一)店頭市場(OTC)	1,506,152	7.05	2,159,328	8.93	-653,176	-30.25
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,434,001	6.71	2,008,776	8.31	-574,775	-28.61
3.買入選擇權(Bought Options)	47,065	0.22	123,131	0.51	-76,066	-61.78
4.賣出選擇權(Sold Options)	25,086	0.12	27,421	0.11	-2,335	-8.52
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	603,579	2.83	674,770	2.79	-71,191	-10.55
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	356,539	1.67	313,001	1.29	43,538	13.91
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	247,040	1.16	361,769	1.50	-114,729	-31.71
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)	19,013,896	89.06	21,043,043	87.08	-2,029,147	-9.64
(一)店頭市場(OTC)	19,009,112	89.04	21,038,766	87.06	-2,029,654	-9.65
1.遠期契約(Outright Forwards)	935,303	4.38	1,195,489	4.95	-260,186	-21.76
2.換匯(FX Swaps)	17,132,874	80.25	18,607,536	77.00	-1,474,662	-7.93
3.換匯換利(Currency Swaps)	88,796	0.42	78,123	0.32	10,673	13.66
4.買入選擇權(Bought Options)	428,418	2.01	582,250	2.41	-153,832	-26.42
5.賣出選擇權(Sold Options)	423,721	1.98	575,368	2.38	-151,647	-26.36
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	4,784	0.02	4,277	0.02	507	11.85
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,124	0.01	1,811	0.01	313	17.28
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,660	0.01	2,466	0.01	194	7.87
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)	199,582	0.93	258,347	1.07	-58,765	-22.75
(一)店頭市場(OTC)	18,238	0.08	13,657	0.06	4,581	33.54
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	181,344	0.85	244,690	1.01	-63,346	-25.89
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	26,376	0.12	23,958	0.10	2,418	10.09
(一)店頭市場(OTC)	8,993	0.04	10,634	0.04	-1,641	-15.43
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	17,383	0.08	13,324	0.06	4,059	30.46
小 計(一至四)	21,349,585	99.99	24,159,446	99.97	-2,809,861	-11.63
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,160	0.01	6,210	0.03	-5,050	-81.32
1.信用違約交換(Credit Default Swaps)	-	-	6,210	0.03	-6,210	-100.00
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)	1,160	0.01	-	-	1,160	-
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	21,350,745	100.00	24,165,656	100.00	-2,814,911	-11.65

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。