

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)	2,847,471	1,416,334	4,263,805	17.57
(一)店頭市場(OTC)	2,847,471	646,326	3,493,797	14.40
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	770,008	770,008	3.17
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Contracts)	7,741,871	12,024,771	19,766,642	81.44
(一)店頭市場(OTC)	7,741,871	12,021,397	19,763,268	81.43
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	3,374	3,374	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-Linked Contracts)	178,846	39,947	218,793	0.90
(一)店頭市場(OTC)	2,031	22,879	24,910	0.10
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	176,815	17,068	193,883	0.80
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	18,451	18,451	0.08
(一)店頭市場(OTC)	-	9,687	9,687	0.04
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	8,764	8,764	0.04
小 計(一至四)	10,768,188	13,499,503	24,267,691	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,693	2,693	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	10,768,188	13,502,196	24,270,384	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9月	金 額	10,768,188	13,502,196	24,270,384
	比 重	44.37	55.63	100.00
115年8月	金 額	8,562,196	12,788,549	21,350,745
	比 重	40.10	59.90	100.00
比較增減	差 額	2,205,992	713,647	2,919,639
	變動率	25.76	5.58	13.67

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9月		115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)	4,263,805	17.57	2,109,731	9.88	2,154,074	102.10
(一)店頭市場(OTC)	3,493,797	14.40	1,506,152	7.05	1,987,645	131.97
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	3,375,411	13.91	1,434,001	6.71	1,941,410	135.38
3.買入選擇權(Bought Options)	92,469	0.38	47,065	0.22	45,404	96.47
4.賣出選擇權(Sold Options)	25,917	0.11	25,086	0.12	831	3.31
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	770,008	3.17	603,579	2.83	166,429	27.57
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	371,129	1.53	356,539	1.67	14,590	4.09
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	398,879	1.64	247,040	1.16	151,839	61.46
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)	19,766,642	81.44	19,013,896	89.06	752,746	3.96
(一)店頭市場(OTC)	19,763,268	81.43	19,009,112	89.04	754,156	3.97
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,063,767	4.38	935,303	4.38	128,464	13.74
2.換匯(FX Swaps)	17,702,522	72.94	17,132,874	80.25	569,648	3.32
3.換匯換利(Currency Swaps)	101,583	0.42	88,796	0.42	12,787	14.40
4.買入選擇權(Bought Options)	462,780	1.91	428,418	2.01	34,362	8.02
5.賣出選擇權(Sold Options)	432,616	1.78	423,721	1.98	8,895	2.10
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	3,374	0.01	4,784	0.02	-1,410	-29.47
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,681	0.00	2,124	0.01	-443	-20.86
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,693	0.01	2,660	0.01	-967	-36.35
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)	218,793	0.90	199,582	0.93	19,211	9.63
(一)店頭市場(OTC)	24,910	0.10	18,238	0.08	6,672	36.58
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	193,883	0.80	181,344	0.85	12,539	6.91
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	18,451	0.08	26,376	0.12	-7,925	-30.05
(一)店頭市場(OTC)	9,687	0.04	8,993	0.04	694	7.72
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	8,764	0.04	17,383	0.08	-8,619	-49.58
小 計(一至四)	24,267,691	99.99	21,349,585	99.99	2,918,106	13.67
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,693	0.01	1,160	0.01	1,533	132.16
1.信用違約交換(Credit Default Swaps)	319	0.00	-	-	319	-
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)	2,374	0.01	1,160	0.01	1,214	104.66
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	24,270,384	100.00	21,350,745	100.00	2,919,639	13.67

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。