

# 附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

## 商 品 種 類 別

111年2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)	424,794	1,375,017	1,799,811	15.88
(一)店頭市場(OTC)	424,794	230,049	654,843	5.78
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,144,968	1,144,968	10.10
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,224,762	5,233,738	9,458,500	83.43
(一)店頭市場(OTC)	4,224,762	5,227,641	9,452,403	83.37
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	6,097	6,097	0.06
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	58,307	13,406	71,713	0.63
(一)店頭市場(OTC)	438	270	708	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	57,869	13,136	71,005	0.62
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	6,999	6,999	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	6,611	6,611	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	388	388	0.00
小 計(一至四)	4,707,863	6,629,160	11,337,023	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	420	420	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	4,707,863	6,629,580	11,337,443	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
111年2月	金 額	4,707,863	6,629,580	11,337,443
	比 重	41.52	58.48	100.00
111年1月	金 額	6,056,620	7,541,023	13,597,643
	比 重	44.54	55.46	100.00
比較增減	差 額	-1,348,757	-911,443	-2,260,200
	變動率	-22.27	-12.09	-16.62

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	111年2月		111年1月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差額	變動率
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	<b>1,799,811</b>	<b>15.88</b>	<b>1,525,971</b>	<b>11.22</b>	<b>273,840</b>	<b>17.95</b>
(一)店頭市場(OTC)	654,843	5.78	704,735	5.18	-49,892	-7.08
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	576,296	5.09	652,955	4.80	-76,659	-11.74
3.買入選擇權(Bought Options)	29,543	0.26	20,766	0.15	8,777	42.27
4.賣出選擇權(Sold Options)	49,004	0.43	31,014	0.23	17,990	58.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,144,968	10.10	821,236	6.04	323,732	39.42
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	569,424	5.02	392,054	2.88	177,370	45.24
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	575,544	5.08	427,804	3.15	147,740	34.53
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	1,378	0.01	-1,378	-100.00
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	<b>9,458,500</b>	<b>83.43</b>	<b>11,943,691</b>	<b>87.84</b>	<b>-2,485,191</b>	<b>-20.81</b>
(一)店頭市場(OTC)	9,452,403	83.37	11,937,827	87.80	-2,485,424	-20.82
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,025,149	9.04	1,043,017	7.67	-17,868	-1.71
2.換匯(Fx Swaps)	7,969,293	70.29	10,269,569	75.53	-2,300,276	-22.40
3.換匯換利(Currency Swaps)	45,512	0.40	42,221	0.31	3,291	7.79
4.買入選擇權(Bought Options)	208,442	1.84	291,556	2.15	-83,114	-28.51
5.賣出選擇權(Sold Options)	204,007	1.80	291,464	2.14	-87,457	-30.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,097	0.06	5,864	0.04	233	3.97
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	3,093	0.03	2,852	0.02	241	8.45
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	3,004	0.03	3,012	0.02	-8	-0.27
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	<b>71,713</b>	<b>0.63</b>	<b>117,766</b>	<b>0.86</b>	<b>-46,053</b>	<b>-39.11</b>
(一)店頭市場(OTC)	708	0.01	1,899	0.01	-1,191	-62.72
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	71,005	0.62	115,867	0.85	-44,862	-38.72
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	<b>6,999</b>	<b>0.06</b>	<b>7,666</b>	<b>0.06</b>	<b>-667</b>	<b>-8.70</b>
(一)店頭市場(OTC)	6,611	0.06	6,980	0.05	-369	-5.29
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	388	0.00	686	0.01	-298	-43.44
<b>小計(一至四)</b>	<b>11,337,023</b>	<b>100.00</b>	<b>13,595,094</b>	<b>99.98</b>	<b>-2,258,071</b>	<b>-16.61</b>
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	<b>420</b>	<b>0.00</b>	<b>2,549</b>	<b>0.02</b>	<b>-2,129</b>	<b>-83.52</b>
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	420	0.00	2,549	0.02	-2,129	-83.52
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)	-	-	-	-	-	-
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
1.遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2.交換(Swaps)	-	-	-	-	-	-
3.選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
<b>總計</b>	<b>11,337,443</b>	<b>100.00</b>	<b>13,597,643</b>	<b>100.00</b>	<b>-2,260,200</b>	<b>-16.62</b>

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。