

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3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)	909,725	2,461,791	3,371,516	20.59
(一)店頭市場(OTC)	909,725	571,968	1,481,693	9.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,889,823	1,889,823	11.54
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,011,248	6,830,254	12,841,502	78.42
(一)店頭市場(OTC)	6,011,248	6,825,623	12,836,871	78.39
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,631	4,631	0.03
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	131,795	13,090	144,885	0.88
(一)店頭市場(OTC)	97	564	661	0.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	131,698	12,526	144,224	0.88
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	53	10,626	10,679	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	9,496	9,496	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	53	1,130	1,183	0.01
小 計(一至四)	7,052,821	9,315,761	16,368,582	99.96
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	6,917	6,917	0.04
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,052,821	9,322,678	16,375,499	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3月	金 額	7,052,821	9,322,678	16,375,499
	比 重	43.07	56.93	100.00
111年2月	金 額	4,707,863	6,629,580	11,337,443
	比 重	41.52	58.48	100.00
比較增減	差 額	2,344,958	2,693,098	5,038,056
	變動率	49.81	40.62	44.44

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3月		111年2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)	3,371,516	20.59	1,799,811	15.88	1,571,705	87.33
(一)店頭市場(OTC)	1,481,693	9.05	654,843	5.78	826,850	126.27
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,404,902	8.58	576,296	5.09	828,606	143.78
3.買入選擇權(Bought Options)	33,949	0.21	29,543	0.26	4,406	14.91
4.賣出選擇權(Sold Options)	42,842	0.26	49,004	0.43	-6,162	-12.57
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,889,823	11.54	1,144,968	10.10	744,855	65.05
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	962,992	5.88	569,424	5.02	393,568	69.12
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	926,831	5.66	575,544	5.08	351,287	61.04
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 Transactions)	12,841,502	78.42	9,458,500	83.43	3,383,002	35.77
(一)店頭市場(OTC)	12,836,871	78.39	9,452,403	83.37	3,384,468	35.81
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,530,620	9.35	1,025,149	9.04	505,471	49.31
2.換匯(Fx Swaps)	10,647,807	65.02	7,969,293	70.29	2,678,514	33.61
3.換匯換利(Currency Swaps)	34,574	0.21	45,512	0.40	-10,938	-24.03
4.買入選擇權(Bought Options)	311,533	1.90	208,442	1.84	103,091	49.46
5.賣出選擇權(Sold Options)	312,337	1.91	204,007	1.80	108,330	53.10
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,631	0.03	6,097	0.06	-1,466	-24.04
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,498	0.02	3,093	0.03	-595	-19.24
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,133	0.01	3,004	0.03	-871	-28.99
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)	144,885	0.88	71,713	0.63	73,172	102.03
(一)店頭市場(OTC)	661	0.00	708	0.01	-47	-6.64
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	144,224	0.88	71,005	0.62	73,219	103.12
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,679	0.07	6,999	0.06	3,680	52.58
(一)店頭市場(OTC)	9,496	0.06	6,611	0.06	2,885	43.64
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,183	0.01	388	0.00	795	204.90
小 計(一至四)	16,368,582	99.96	11,337,023	100.00	5,031,559	44.38
五、信用有關契約(Credit Contracts)	6,917	0.04	420	0.00	6,497	1,546.90
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	6,917	0.04	420	0.00	6,497	1,546.90
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)	-	-	-	-	-	-
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	16,375,499	100.00	11,337,443	100.00	5,038,056	44.44

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。