

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

112年1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)	188,579	898,160	1,086,739	8.34
(一)店頭市場(OTC)	188,579	147,502	336,081	2.58
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	750,658	750,658	5.76
二、匯率有關契約 (Foreign Exchange Transactions)	5,196,682	6,689,753	11,886,435	91.24
(一)店頭市場(OTC)	5,196,682	6,686,045	11,882,727	91.21
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,708	3,708	0.03
三、權益證券有關契約 (Equity-linked Contracts)	36,550	8,018	44,568	0.34
(一)店頭市場(OTC)	5	1,865	1,870	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	36,545	6,153	42,698	0.33
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	-	9,751	9,751	0.08
(一)店頭市場(OTC)	-	5,303	5,303	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,448	4,448	0.04
小 計(一至四)	5,421,811	7,605,682	13,027,493	100.00
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	-	-	-	-
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	5,421,811	7,605,682	13,027,493	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
112年1月	金 額	5,421,811	7,605,682	13,027,493
	比 重	41.62	58.38	100.00
111年12月	金 額	7,141,250	7,544,208	14,685,458
	比 重	48.63	51.37	100.00
比較增減	差 額	-1,719,439	61,474	-1,657,965
	變動率	-24.08	0.81	-11.29

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	112年1月		111年12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)	1,086,739	8.34	1,039,694	7.08	47,045	4.52
(一)店頭市場(OTC)	336,081	2.58	531,819	3.62	-195,738	-36.81
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	301,504	2.31	509,348	3.47	-207,844	-40.81
3.買入選擇權(Bought Options)	15,462	0.12	10,510	0.07	4,952	47.12
4.賣出選擇權(Sold Options)	19,115	0.15	11,961	0.08	7,154	59.81
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	750,658	5.76	507,875	3.46	242,783	47.80
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	351,711	2.70	262,112	1.79	89,599	34.18
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	398,947	3.06	245,763	1.67	153,184	62.33
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)	11,886,435	91.24	13,603,465	92.63	-1,717,030	-12.62
(一)店頭市場(OTC)	11,882,727	91.21	13,600,371	92.61	-1,717,644	-12.63
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,281,990	9.84	1,210,540	8.24	71,450	5.90
2.換匯(Fx Swaps)	10,103,483	77.56	12,084,114	82.29	-1,980,631	-16.39
3.換匯換利(Currency Swaps)	12,293	0.09	29,971	0.20	-17,678	-58.98
4.買入選擇權(Bought Options)	245,125	1.88	139,355	0.95	105,770	75.90
5.賣出選擇權(Sold Options)	239,836	1.84	136,391	0.93	103,445	75.84
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,708	0.03	3,094	0.02	614	19.84
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,220	0.02	1,166	0.01	1,054	90.39
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,488	0.01	1,928	0.01	-440	-22.82
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)	44,568	0.34	37,306	0.26	7,262	19.47
(一)店頭市場(OTC)	1,870	0.01	2,464	0.02	-594	-24.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	42,698	0.33	34,842	0.24	7,856	22.55
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	9,751	0.08	4,620	0.03	5,131	111.06
(一)店頭市場(OTC)	5,303	0.04	3,689	0.02	1,614	43.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,448	0.04	931	0.01	3,517	377.77
小 計(一至四)	13,027,493	100.00	14,685,085	100.00	-1,657,592	-11.29
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	-	373	0.00	-373	-100.00
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	-	-	373	0.00	-373	-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(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	13,027,493	100.00	14,685,458	100.00	-1,657,965	-11.29

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。