

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)	412,071	1,211,989	1,624,060	10.33
(一)店頭市場(OTC)	412,071	237,622	649,693	4.13
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	974,367	974,367	6.20
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,953,880	8,032,149	13,986,029	88.95
(一)店頭市場(OTC)	5,953,880	8,030,182	13,984,062	88.94
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,967	1,967	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	71,476	31,026	102,502	0.65
(一)店頭市場(OTC)	-	4,488	4,488	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	71,476	26,538	98,014	0.62
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	10,443	10,443	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	5,401	5,401	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	5,042	5,042	0.03
小 計(一至四)	6,437,427	9,285,607	15,723,034	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,067	1,067	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,437,427	9,286,674	15,724,101	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2月	金 額	6,437,427	9,286,674	15,724,101
	比 重	40.94	59.06	100.00
112年1月	金 額	5,421,811	7,605,682	13,027,493
	比 重	41.62	58.38	100.00
比較增減	差 額	1,015,616	1,680,992	2,696,608
	變動率	18.73	22.10	20.70

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2月		112年1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)	1,624,060	10.33	1,086,739	8.34	537,321	49.44
(一)店頭市場(OTC)	649,693	4.13	336,081	2.58	313,612	93.31
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	612,543	3.90	301,504	2.31	311,039	103.16
3.買入選擇權(Bought Options)	14,148	0.09	15,462	0.12	-1,314	-8.50
4.賣出選擇權(Sold Options)	23,002	0.14	19,115	0.15	3,887	20.33
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	974,367	6.20	750,658	5.76	223,709	29.80
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	470,297	2.99	351,711	2.70	118,586	33.72
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	504,070	3.21	398,947	3.06	105,123	26.35
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)	13,986,029	88.95	11,886,435	91.24	2,099,594	17.66
(一)店頭市場(OTC)	13,984,062	88.94	11,882,727	91.21	2,101,335	17.68
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,703,561	10.84	1,281,990	9.84	421,571	32.88
2.換匯(Fx Swaps)	11,612,269	73.85	10,103,483	77.56	1,508,786	14.93
3.換匯換利(Currency Swaps)	25,374	0.16	12,293	0.09	13,081	106.41
4.買入選擇權(Bought Options)	321,791	2.05	245,125	1.88	76,666	31.28
5.賣出選擇權(Sold Options)	321,067	2.04	239,836	1.84	81,231	33.87
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,967	0.01	3,708	0.03	-1,741	-46.95
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	762	0.00	2,220	0.02	-1,458	-65.68
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,205	0.01	1,488	0.01	-283	-19.02
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)	102,502	0.65	44,568	0.34	57,934	129.99
(一)店頭市場(OTC)	4,488	0.03	1,870	0.01	2,618	140.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	98,014	0.62	42,698	0.33	55,316	129.55
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,443	0.06	9,751	0.08	692	7.10
(一)店頭市場(OTC)	5,401	0.03	5,303	0.04	98	1.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,042	0.03	4,448	0.04	594	13.35
小 計(一至四)	15,723,034	99.99	13,027,493	100.00	2,695,541	20.69
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,067	0.01	-	-	1,067	-
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,067	0.01	-	-	1,067	-
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	15,724,101	100.00	13,027,493	100.00	2,696,608	20.70

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。