

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)	666,385	2,226,604	2,892,989	13.91
(一)店頭市場(OTC)	666,385	527,046	1,193,431	5.74
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,699,558	1,699,558	8.17
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,855,250	9,893,539	17,748,789	85.31
(一)店頭市場(OTC)	7,855,250	9,890,897	17,746,147	85.30
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,642	2,642	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	108,970	38,950	147,920	0.71
(一)店頭市場(OTC)	-	4,855	4,855	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	108,970	34,095	143,065	0.69
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	13,044	13,044	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	5,045	5,045	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	7,999	7,999	0.04
小 計(一至四)	8,630,605	12,172,137	20,802,742	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,218	1,218	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	8,630,605	12,173,355	20,803,960	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3月	金 額	8,630,605	12,173,355	20,803,960
	比 重	41.49	58.51	100.00
112年2月	金 額	6,437,427	r 9,291,586	r 15,729,013
	比 重	r 40.93	r 59.07	100.00
比較增減	差 額	2,193,178	2,881,769	5,074,947
	變動率	34.07	31.01	32.26

註：r為修正數。

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3月		112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)	2,892,989	13.91	1,624,060	10.33	1,268,929	78.13
(一)店頭市場(OTC)	1,193,431	5.74	649,693	4.13	543,738	83.69
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,153,572	5.55	612,543	3.89	541,029	88.33
3.買入選擇權(Bought Options)	12,313	0.06	14,148	0.09	-1,835	-12.97
4.賣出選擇權(Sold Options)	27,546	0.13	23,002	0.15	4,544	19.75
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,699,558	8.17	974,367	6.20	725,191	74.43
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	851,426	4.09	470,297	2.99	381,129	81.04
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	848,132	4.08	504,070	3.21	344,062	68.26
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)	17,748,789	85.31	13,990,941	88.95	3,757,848	26.86
(一)店頭市場(OTC)	17,746,147	85.30	13,988,974	88.94	3,757,173	26.86
1.遠期契約(Outright Forwards)	2,225,359	10.69	1,703,561	10.83	521,798	30.63
2.換匯(Fx Swaps)	14,681,337	70.57	11,617,181	73.86	3,064,156	26.38
3.換匯換利(Currency Swaps)	54,328	0.26	25,374	0.16	28,954	114.11
4.買入選擇權(Bought Options)	392,659	1.89	321,791	2.05	70,868	22.02
5.賣出選擇權(Sold Options)	392,464	1.89	321,067	2.04	71,397	22.24
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,642	0.01	1,967	0.01	675	34.32
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,258	0.00	762	0.00	496	65.09
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,384	0.01	1,205	0.01	179	14.85
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)	147,920	0.71	102,502	0.65	45,418	44.31
(一)店頭市場(OTC)	4,855	0.02	4,488	0.03	367	8.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	143,065	0.69	98,014	0.62	45,051	45.96
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	13,044	0.06	10,443	0.06	2,601	24.91
(一)店頭市場(OTC)	5,045	0.02	5,401	0.03	-356	-6.59
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,999	0.04	5,042	0.03	2,957	58.65
小 計(一至四)	20,802,742	99.99	15,727,946	99.99	5,074,796	32.27
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,218	0.01	1,067	0.01	151	14.15
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,218	0.01	1,067	0.01	151	14.15
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	20,803,960	100.00	15,729,013	100.00	5,074,947	32.26

註：1.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。

2. r為修正數。