

# 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10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           |
| <b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>       | <b>478,936</b>     | <b>1,175,060</b> | <b>1,653,996</b>  | <b>9.92</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 478,936            | 173,015          | 651,951           | 3.91          |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | -                  | 1,002,045        | 1,002,045         | 6.01          |
| <b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b> | <b>6,518,132</b>   | <b>8,382,450</b> | <b>14,900,582</b> | <b>89.39</b>  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 6,518,132          | 8,380,225        | 14,898,357        | 89.38         |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | -                  | 2,225            | 2,225             | 0.01          |
| <b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>     | <b>69,209</b>      | <b>33,665</b>    | <b>102,874</b>    | <b>0.62</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | -                  | 2,571            | 2,571             | 0.02          |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 69,209             | 31,094           | 100,303           | 0.60          |
| <b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>           | <b>-</b>           | <b>10,065</b>    | <b>10,065</b>     | <b>0.06</b>   |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | -                  | 3,916            | 3,916             | 0.02          |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | -                  | 6,149            | 6,149             | 0.04          |
| <b>小 計(一至四)</b>                                | <b>7,066,277</b>   | <b>9,601,240</b> | <b>16,667,517</b> | <b>99.99</b>  |
| <b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>              | <b>-</b>           | <b>1,349</b>     | <b>1,349</b>      | <b>0.01</b>   |
| <b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>               | <b>-</b>           | <b>-</b>         | <b>-</b>          | <b>-</b>      |
| <b>總 計</b>                                     | <b>7,066,277</b>   | <b>9,602,589</b> | <b>16,668,866</b> | <b>100.00</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。

## 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10月 | 金 額 | 7,066,277 | 9,602,589 | 16,668,866 |
|         | 比 重 | 42.39     | 57.61     | 100.00     |
| 112年9月  | 金 額 | 6,998,102 | 9,568,209 | 16,566,311 |
|         | 比 重 | 42.24     | 57.76     | 100.00     |
| 比較增減    | 差 額 | 68,175    | 34,380    | 102,555    |
|         | 變動率 | 0.97      | 0.36      | 0.62       |

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                                        | 112年10月           |               | 112年9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>1,653,996</b>  | <b>9.92</b>   | <b>1,547,197</b>  | <b>9.34</b>   | <b>106,799</b> | <b>6.90</b>  |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 651,951           | 3.91          | 751,131           | 4.54          | -99,180        | -13.20       |
| 1.遠期利率協議(FRA)                                  | -                 | -             | -                 | -             | -              | -            |
| 2.換利(IRS)                                      | 637,692           | 3.82          | 737,127           | 4.45          | -99,435        | -13.49       |
| 3.買入選擇權(Bought Options)                        | 4,438             | 0.03          | 5,872             | 0.04          | -1,434         | -24.42       |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)                          | 9,821             | 0.06          | 8,132             | 0.05          | 1,689          | 20.77        |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 1,002,045         | 6.01          | 796,066           | 4.80          | 205,979        | 25.87        |
| 1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)             | 499,959           | 3.00          | 393,204           | 2.37          | 106,755        | 27.15        |
| 2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)            | 502,086           | 3.01          | 402,862           | 2.43          | 99,224         | 24.63        |
| 3.買入選擇權(Bought Options)                        | -                 | -             | -                 | -             | -              | -            |
| 4.賣出選擇權(Sold Options)                          | -                 | -             | -                 | -             | -              | -            |
| <b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b> | <b>14,900,582</b> | <b>89.39</b>  | <b>14,929,473</b> | <b>90.12</b>  | <b>-28,891</b> | <b>-0.19</b> |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 14,898,357        | 89.38         | 14,927,511        | 90.11         | -29,154        | -0.20        |
| 1.遠期契約(Outright Forwards)                      | 1,440,015         | 8.64          | 1,552,599         | 9.37          | -112,584       | -7.25        |
| 2.換匯(Fx Swaps)                                 | 12,493,756        | 74.95         | 12,617,669        | 76.17         | -123,913       | -0.98        |
| 3.換匯換利(Currency Swaps)                         | 45,555            | 0.27          | 38,555            | 0.23          | 7,000          | 18.16        |
| 4.買入選擇權(Bought Options)                        | 459,863           | 2.76          | 360,517           | 2.18          | 99,346         | 27.56        |
| 5.賣出選擇權(Sold Options)                          | 459,168           | 2.76          | 358,171           | 2.16          | 100,997        | 28.20        |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 2,225             | 0.01          | 1,962             | 0.01          | 263            | 13.40        |
| 1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)             | 873               | 0.00          | 943               | 0.00          | -70            | -7.42        |
| 2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)            | 1,352             | 0.01          | 1,019             | 0.01          | 333            | 32.68        |
| 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>102,874</b>    | <b>0.62</b>   | <b>81,291</b>     | <b>0.49</b>   | <b>21,583</b>  | <b>26.55</b> |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 2,571             | 0.02          | 4,059             | 0.02          | -1,488         | -36.66       |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 100,303           | 0.60          | 77,232            | 0.47          | 23,071         | 29.87        |
| <b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>           | <b>10,065</b>     | <b>0.06</b>   | <b>7,544</b>      | <b>0.05</b>   | <b>2,521</b>   | <b>33.42</b> |
| (一)店頭市場(OTC)                                   | 3,916             | 0.02          | 3,838             | 0.03          | 78             | 2.03         |
| (二)交易所(Exchange-traded Contracts)              | 6,149             | 0.04          | 3,706             | 0.02          | 2,443          | 65.92        |
| <b>小 計(一至四)</b>                                | <b>16,667,517</b> | <b>99.99</b>  | <b>16,565,505</b> | <b>100.00</b> | <b>102,012</b> | <b>0.62</b>  |
| <b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>              | <b>1,349</b>      | <b>0.01</b>   | <b>806</b>        | <b>0.00</b>   | <b>543</b>     | <b>67.37</b> |
| 1.信用違約交換(Credit Default Swap)                  | 1,349             | 0.01          | 806               | 0.00          | 543            | 67.37        |
| 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>16,668,866</b> | <b>100.00</b> | <b>16,566,311</b> | <b>100.00</b> | <b>102,555</b> | <b>0.62</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。