

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12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)	654,800	731,334	1,386,134	8.11
(一)店頭市場(OTC)	654,800	153,773	808,573	4.73
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	577,561	577,561	3.38
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,790,155	8,869,329	15,659,484	91.61
(一)店頭市場(OTC)	6,790,155	8,867,761	15,657,916	91.60
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,568	1,568	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	24,793	15,758	40,551	0.24
(一)店頭市場(OTC)	-	9,622	9,622	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	24,793	6,136	30,929	0.18
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	6,525	6,525	0.04
(一)店頭市場(OTC)	-	5,399	5,399	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,126	1,126	0.01
小 計(一至四)	7,469,748	9,622,946	17,092,694	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	785	785	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,469,748	9,623,731	17,093,479	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12月	金 額	7,469,748	9,623,731	17,093,479
	比 重	43.70	56.30	100.00
112年11月	金 額	7,997,313	11,612,459	19,609,772
	比 重	40.78	59.22	100.00
比較增減	差 額	-527,565	-1,988,728	-2,516,293
	變動率	-6.60	-17.13	-12.83

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12月		112年11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)	1,386,134	8.11	1,948,837	9.94	-562,703	-28.87
(一)店頭市場(OTC)	808,573	4.73	919,007	4.69	-110,434	-12.02
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	798,614	4.67	865,143	4.41	-66,529	-7.69
3.買入選擇權(Bought Options)	4,110	0.03	20,599	0.11	-16,489	-80.05
4.賣出選擇權(Sold Options)	5,849	0.03	33,265	0.17	-27,416	-82.42
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	577,561	3.38	1,029,830	5.25	-452,269	-43.92
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	303,088	1.77	515,763	2.63	-212,675	-41.24
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	274,473	1.61	514,067	2.62	-239,594	-46.61
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)	15,659,484	91.61	17,558,124	89.54	-1,898,640	-10.81
(一)店頭市場(OTC)	15,657,916	91.60	17,553,397	89.51	-1,895,481	-10.80
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,709,273	10.00	2,314,473	11.80	-605,200	-26.15
2.換匯(Fx Swaps)	13,410,720	78.45	14,318,613	73.02	-907,893	-6.34
3.換匯換利(Currency Swaps)	44,632	0.26	64,437	0.33	-19,805	-30.74
4.買入選擇權(Bought Options)	251,318	1.47	431,609	2.20	-180,291	-41.77
5.賣出選擇權(Sold Options)	241,973	1.42	424,265	2.16	-182,292	-42.97
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,568	0.01	4,727	0.03	-3,159	-66.83
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	495	0.00	2,918	0.02	-2,423	-83.04
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,073	0.01	1,809	0.01	-736	-40.69
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)	40,551	0.24	95,094	0.48	-54,543	-57.36
(一)店頭市場(OTC)	9,622	0.06	2,795	0.01	6,827	244.26
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	30,929	0.18	92,299	0.47	-61,370	-66.49
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	6,525	0.04	7,011	0.04	-486	-6.93
(一)店頭市場(OTC)	5,399	0.03	2,509	0.01	2,890	115.19
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,126	0.01	4,502	0.03	-3,376	-74.99
小計(一至四)	17,092,694	100.00	19,609,066	100.00	-2,516,372	-12.83
五、信用有關契約(Credit Contracts)	785	0.00	706	0.00	79	11.19
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	785	0.00	706	0.00	79	11.19
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	17,093,479	100.00	19,609,772	100.00	-2,516,293	-12.83

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。