

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

113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)	955,146	1,920,228	2,875,374	12.99
(一)店頭市場(OTC)	955,146	325,350	1,280,496	5.79
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,594,878	1,594,878	7.20
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,240,417	11,939,714	19,180,131	86.63
(一)店頭市場(OTC)	7,240,417	11,936,581	19,176,998	86.61
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,133	3,133	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	42,114	27,147	69,261	0.31
(一)店頭市場(OTC)	70	10,547	10,617	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	42,044	16,600	58,644	0.26
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	13,629	13,629	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	6,525	6,525	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	7,104	7,104	0.03
小 計(一至四)	8,237,677	13,900,718	22,138,395	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,607	2,607	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	8,237,677	13,903,325	22,141,002	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
113年1月	金 額	8,237,677	13,903,325	22,141,002
	比 重	37.21	62.79	100.00
112年12月	金 額	7,469,748	9,623,731	17,093,479
	比 重	43.70	56.30	100.00
比較增減	差 額	767,929	4,279,594	5,047,523
	變動率	10.28	44.47	29.53

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	113年1月		112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)	2,875,374	12.99	1,386,134	8.11	1,489,240	107.44
(一)店頭市場(OTC)	1,280,496	5.79	808,573	4.73	471,923	58.36
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,249,933	5.65	798,614	4.67	451,319	56.51
3.買入選擇權(Bought Options)	14,169	0.07	4,110	0.03	10,059	244.74
4.賣出選擇權(Sold Options)	16,394	0.07	5,849	0.03	10,545	180.29
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,594,878	7.20	577,561	3.38	1,017,317	176.14
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	666,519	3.01	303,088	1.77	363,431	119.91
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	928,301	4.19	274,473	1.61	653,828	238.21
3.買入選擇權(Bought Options)	39	-	-	-	39	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	19	-	-	-	19	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	19,180,131	86.63	15,659,484	91.61	3,520,647	22.48
(一)店頭市場(OTC)	19,176,998	86.61	15,657,916	91.60	3,519,082	22.47
1.遠期契約(Outright Forwards)	2,258,479	10.20	1,709,273	10.00	549,206	32.13
2.換匯(Fx Swaps)	15,808,020	71.40	13,410,720	78.45	2,397,300	17.88
3.換匯換利(Currency Swaps)	45,927	0.21	44,632	0.26	1,295	2.90
4.買入選擇權(Bought Options)	532,122	2.40	251,318	1.47	280,804	111.73
5.賣出選擇權(Sold Options)	532,450	2.40	241,973	1.42	290,477	120.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,133	0.02	1,568	0.01	1,565	99.81
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,748	0.01	495	0.00	1,253	253.13
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,385	0.01	1,073	0.01	312	29.08
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)	69,261	0.31	40,551	0.24	28,710	70.80
(一)店頭市場(OTC)	10,617	0.05	9,622	0.06	995	10.34
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	58,644	0.26	30,929	0.18	27,715	89.61
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	13,629	0.06	6,525	0.04	7,104	108.87
(一)店頭市場(OTC)	6,525	0.03	5,399	0.03	1,126	20.86
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,104	0.03	1,126	0.01	5,978	530.91
小 計(一至四)	22,138,395	99.99	17,092,694	100.00	5,045,701	29.52
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,607	0.01	785	0.00	1,822	232.10
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,607	0.01	785	0.00	1,822	232.10
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	22,141,002	100.00	17,093,479	100.00	5,047,523	29.53

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。