

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)	485,293	1,757,885	2,243,178	13.72
(一)店頭市場(OTC)	485,293	319,541	804,834	4.92
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,438,344	1,438,344	8.80
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,425,469	8,603,872	14,029,341	85.85
(一)店頭市場(OTC)	5,425,469	8,601,827	14,027,296	85.84
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,045	2,045	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	41,621	17,508	59,129	0.36
(一)店頭市場(OTC)	-	4,189	4,189	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	41,621	13,319	54,940	0.34
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	7,754	7,754	0.05
(一)店頭市場(OTC)	-	4,985	4,985	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,769	2,769	0.02
小 計(一至四)	5,952,383	10,387,019	16,339,402	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,592	2,592	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,952,383	10,389,611	16,341,994	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2月	金 額	5,952,383	10,389,611	16,341,994
	比 重	36.42	63.58	100.00
113年1月	金 額	8,237,677	13,903,325	22,141,002
	比 重	37.21	62.79	100.00
比較增減	差 額	-2,285,294	-3,513,714	-5,799,008
	變動率	-27.74	-25.27	-26.19

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2月		113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)	2,243,178	13.72	2,875,374	12.99	-632,196	-21.99
(一)店頭市場(OTC)	804,834	4.92	1,280,496	5.79	-475,662	-37.15
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	775,163	4.74	1,249,933	5.65	-474,770	-37.98
3.買入選擇權(Bought Options)	8,298	0.05	14,169	0.07	-5,871	-41.44
4.賣出選擇權(Sold Options)	21,373	0.13	16,394	0.07	4,979	30.37
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,438,344	8.80	1,594,878	7.20	-156,534	-9.81
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	896,773	5.49	666,519	3.01	230,254	34.55
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	541,544	3.31	928,301	4.19	-386,757	-41.66
3.買入選擇權(Bought Options)	27	0.00	39	-	-12	-30.77
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	19	-	-19	-100.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	14,029,341	85.85	19,180,131	86.63	-5,150,790	-26.85
(一)店頭市場(OTC)	14,027,296	85.84	19,176,998	86.61	-5,149,702	-26.85
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,479,855	9.05	2,258,479	10.20	-778,624	-34.48
2.換匯(Fx Swaps)	11,505,716	70.41	15,808,020	71.40	-4,302,304	-27.22
3.換匯換利(Currency Swaps)	48,911	0.30	45,927	0.21	2,984	6.50
4.買入選擇權(Bought Options)	493,195	3.02	532,122	2.40	-38,927	-7.32
5.賣出選擇權(Sold Options)	499,619	3.06	532,450	2.40	-32,831	-6.17
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,045	0.01	3,133	0.02	-1,088	-34.73
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	914	0.00	1,748	0.01	-834	-47.71
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,131	0.01	1,385	0.01	-254	-18.34
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)	59,129	0.36	69,261	0.31	-10,132	-14.63
(一)店頭市場(OTC)	4,189	0.02	10,617	0.05	-6,428	-60.54
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	54,940	0.34	58,644	0.26	-3,704	-6.32
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	7,754	0.05	13,629	0.06	-5,875	-43.11
(一)店頭市場(OTC)	4,985	0.03	6,525	0.03	-1,540	-23.60
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,769	0.02	7,104	0.03	-4,335	-61.02
小 計(一至四)	16,339,402	99.98	22,138,395	99.99	-5,798,993	-26.19
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,592	0.02	2,607	0.01	-15	-0.58
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,592	0.02	2,607	0.01	-15	-0.58
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	16,341,994	100.00	22,141,002	100.00	-5,799,008	-26.19

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。