

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)	1,371,164	1,241,231	2,612,395	12.23
(一)店頭市場(OTC)	1,371,164	191,662	1,562,826	7.32
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,049,569	1,049,569	4.91
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,179,208	11,449,020	18,628,228	87.24
(一)店頭市場(OTC)	7,179,208	11,445,174	18,624,382	87.22
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,846	3,846	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	70,918	31,345	102,263	0.48
(一)店頭市場(OTC)	-	8,843	8,843	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	70,918	22,502	93,420	0.44
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	8,058	8,058	0.04
(一)店頭市場(OTC)	-	2,874	2,874	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	5,184	5,184	0.03
小 計(一至四)	8,621,290	12,729,654	21,350,944	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,650	1,650	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	8,621,290	12,731,304	21,352,594	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3月	金 額	8,621,290	12,731,304	21,352,594
	比 重	40.38	59.62	100.00
113年2月	金 額	5,952,383	10,389,611	16,341,994
	比 重	36.42	63.58	100.00
比較增減	差 額	2,668,907	2,341,693	5,010,600
	變動率	44.84	22.54	30.66

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3月		113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)	2,612,395	12.23	2,243,178	13.72	369,217	16.46
(一)店頭市場(OTC)	1,562,826	7.32	804,834	4.92	757,992	94.18
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,537,420	7.20	775,163	4.74	762,257	98.34
3.買入選擇權(Bought Options)	13,263	0.06	8,298	0.05	4,965	59.83
4.賣出選擇權(Sold Options)	12,143	0.06	21,373	0.13	-9,230	-43.19
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,049,569	4.91	1,438,344	8.80	-388,775	-27.03
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	468,818	2.19	896,773	5.49	-427,955	-47.72
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	580,751	2.72	541,544	3.31	39,207	7.24
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	27	0.00	-27	-100.00
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	18,628,228	87.24	14,029,341	85.85	4,598,887	32.78
(一)店頭市場(OTC)	18,624,382	87.22	14,027,296	85.84	4,597,086	32.77
1.遠期契約(Outright Forwards)	2,361,006	11.05	1,479,855	9.05	881,151	59.54
2.換匯(Fx Swaps)	15,367,551	71.97	11,505,716	70.41	3,861,835	33.56
3.換匯換利(Currency Swaps)	50,878	0.24	48,911	0.30	1,967	4.02
4.買入選擇權(Bought Options)	413,694	1.94	493,195	3.02	-79,501	-16.12
5.賣出選擇權(Sold Options)	431,253	2.02	499,619	3.06	-68,366	-13.68
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,846	0.02	2,045	0.01	1,801	88.07
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,177	0.01	914	0.00	1,263	138.18
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,669	0.01	1,131	0.01	538	47.57
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)	102,263	0.48	59,129	0.36	43,134	72.95
(一)店頭市場(OTC)	8,843	0.04	4,189	0.02	4,654	111.10
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	93,420	0.44	54,940	0.34	38,480	70.04
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	8,058	0.04	7,754	0.05	304	3.92
(一)店頭市場(OTC)	2,874	0.01	4,985	0.03	-2,111	-42.35
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,184	0.03	2,769	0.02	2,415	87.22
小 計(一至四)	21,350,944	99.99	16,339,402	99.98	5,011,542	30.67
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,650	0.01	2,592	0.02	-942	-36.34
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,650	0.01	2,592	0.02	-942	-36.34
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	21,352,594	100.00	16,341,994	100.00	5,010,600	30.66

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。