

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)	1,223,096	607,275	1,830,371	8.74
(一)店頭市場(OTC)	1,223,096	169,951	1,393,047	6.65
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	437,324	437,324	2.09
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,610,497	12,432,796	19,043,293	90.93
(一)店頭市場(OTC)	6,610,497	12,429,914	19,040,411	90.92
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,882	2,882	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	46,860	14,416	61,276	0.29
(一)店頭市場(OTC)	-	6,669	6,669	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	46,860	7,747	54,607	0.26
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	7,256	7,256	0.04
(一)店頭市場(OTC)	-	4,701	4,701	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,555	2,555	0.01
小 計(一至四)	7,880,453	13,061,743	20,942,196	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	328	328	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,880,453	13,062,071	20,942,524	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12月	金 額	7,880,453	13,062,071	20,942,524
	比 重	37.63	62.37	100.00
113年11月	金 額	8,222,694	15,702,372	23,925,066
	比 重	34.37	65.63	100.00
比較增減	差 額	-342,241	-2,640,301	-2,982,542
	變動率	-4.16	-16.81	-12.47

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12月		113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)	1,830,371	8.74	2,125,159	8.88	-294,788	-13.87
(一)店頭市場(OTC)	1,393,047	6.65	1,083,201	4.53	309,846	28.60
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,380,121	6.59	1,048,384	4.38	331,737	31.64
3.買入選擇權(Bought Options)	6,409	0.03	12,596	0.05	-6,187	-49.12
4.賣出選擇權(Sold Options)	6,517	0.03	22,221	0.10	-15,704	-70.67
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	437,324	2.09	1,041,958	4.35	-604,634	-58.03
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	226,053	1.08	532,811	2.22	-306,758	-57.57
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	211,271	1.01	509,147	2.13	-297,876	-58.50
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)	19,043,293	90.93	21,708,718	90.74	-2,665,425	-12.28
(一)店頭市場(OTC)	19,040,411	90.92	21,704,798	90.72	-2,664,387	-12.28
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,954,332	9.33	2,484,072	10.38	-529,740	-21.33
2.換匯(Fx Swaps)	16,187,755	77.30	18,222,546	76.17	-2,034,791	-11.17
3.換匯換利(Currency Swaps)	86,069	0.41	58,075	0.24	27,994	48.20
4.買入選擇權(Bought Options)	404,883	1.93	465,756	1.95	-60,873	-13.07
5.賣出選擇權(Sold Options)	407,372	1.95	474,349	1.98	-66,977	-14.12
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,882	0.01	3,920	0.02	-1,038	-26.48
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,472	0.01	1,573	0.01	-101	-6.42
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,410	0.00	2,347	0.01	-937	-39.92
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)	61,276	0.29	82,038	0.34	-20,762	-25.31
(一)店頭市場(OTC)	6,669	0.03	5,367	0.02	1,302	24.26
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	54,607	0.26	76,671	0.32	-22,064	-28.78
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	7,256	0.04	8,826	0.04	-1,570	-17.79
(一)店頭市場(OTC)	4,701	0.03	5,905	0.03	-1,204	-20.39
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,555	0.01	2,921	0.01	-366	-12.53
小 計(一至四)	20,942,196	100.00	23,924,741	100.00	-2,982,545	-12.47
五、信用有關契約(Credit Contracts)	328	0.00	325	0.00	3	0.92
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	328	0.00	325	0.00	3	0.92
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	20,942,524	100.00	23,925,066	100.00	-2,982,542	-12.47

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。