

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

114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)	1,142,333	1,009,177	2,151,510	10.76
(一)店頭市場(OTC)	1,142,333	287,371	1,429,704	7.15
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	721,806	721,806	3.61
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,848,322	11,904,623	17,752,945	88.82
(一)店頭市場(OTC)	5,848,322	11,900,038	17,748,360	88.80
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,585	4,585	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	53,977	20,059	74,036	0.37
(一)店頭市場(OTC)	69	7,804	7,873	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	53,908	12,255	66,163	0.33
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	5,418	5,418	0.03
(一)店頭市場(OTC)	-	3,663	3,663	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,755	1,755	0.01
小 計(一至四)	7,044,632	12,939,277	19,983,909	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	404	4,093	4,497	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,045,036	12,943,370	19,988,406	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
114年1月	金 額	7,045,036	12,943,370	19,988,406
	比 重	35.25	64.75	100.00
113年12月	金 額	7,880,453	13,062,071	20,942,524
	比 重	37.63	62.37	100.00
比較增減	差 額	-835,417	-118,701	-954,118
	變動率	-10.60	-0.91	-4.56

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	114年1月		113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)	2,151,510	10.76	1,830,371	8.74	321,139	17.55
(一)店頭市場(OTC)	1,429,704	7.15	1,393,047	6.65	36,657	2.63
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,402,938	7.02	1,380,121	6.59	22,817	1.65
3.買入選擇權(Bought Options)	15,200	0.08	6,409	0.03	8,791	137.17
4.賣出選擇權(Sold Options)	11,566	0.05	6,517	0.03	5,049	77.47
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	721,806	3.61	437,324	2.09	284,482	65.05
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	354,421	1.77	226,053	1.08	128,368	56.79
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	367,385	1.84	211,271	1.01	156,114	73.89
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)	17,752,945	88.82	19,043,293	90.93	-1,290,348	-6.78
(一)店頭市場(OTC)	17,748,360	88.80	19,040,411	90.92	-1,292,051	-6.79
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,336,679	6.69	1,954,332	9.33	-617,653	-31.60
2.換匯(Fx Swaps)	15,406,882	77.08	16,187,755	77.30	-780,873	-4.82
3.換匯換利(Currency Swaps)	104,092	0.52	86,069	0.41	18,023	20.94
4.買入選擇權(Bought Options)	440,823	2.21	404,883	1.93	35,940	8.88
5.賣出選擇權(Sold Options)	459,884	2.30	407,372	1.95	52,512	12.89
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,585	0.02	2,882	0.01	1,703	59.09
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,013	0.01	1,472	0.01	541	36.75
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,572	0.01	1,410	0.00	1,162	82.41
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)	74,036	0.37	61,276	0.29	12,760	20.82
(一)店頭市場(OTC)	7,873	0.04	6,669	0.03	1,204	18.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	66,163	0.33	54,607	0.26	11,556	21.16
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	5,418	0.03	7,256	0.04	-1,838	-25.33
(一)店頭市場(OTC)	3,663	0.02	4,701	0.03	-1,038	-22.08
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,755	0.01	2,555	0.01	-800	-31.31
小 計(一至四)	19,983,909	99.98	20,942,196	100.00	-958,287	-4.58
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,497	0.02	328	0.00	4,169	1271.04
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	4,093	0.02	328	0.00	3,765	1147.87
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)	404	0.00	-	-	404	-
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	19,988,406	100.00	20,942,524	100.00	-954,118	-4.56

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。