

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)	1,364,454	1,395,643	2,760,097	12.25
(一)店頭市場(OTC)	1,364,454	307,735	1,672,189	7.42
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,087,908	1,087,908	4.83
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,549,682	13,116,351	19,666,033	87.27
(一)店頭市場(OTC)	6,549,682	13,113,493	19,663,175	87.26
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,858	2,858	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	73,023	26,725	99,748	0.44
(一)店頭市場(OTC)	100	7,483	7,583	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	72,923	19,242	92,165	0.41
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	7,361	7,361	0.03
(一)店頭市場(OTC)	-	4,446	4,446	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,915	2,915	0.01
小 計(一至四)	7,987,159	14,546,080	22,533,239	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,485	1,485	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,987,159	14,547,565	22,534,724	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2月	金 額	7,987,159	14,547,565	22,534,724
	比 重	35.44	64.56	100.00
114年1月	金 額	7,045,036	12,943,370	19,988,406
	比 重	35.25	64.75	100.00
比較增減	差 額	942,123	1,604,195	2,546,318
	變動率	13.37	12.39	12.74

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2月		114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)	2,760,097	12.25	2,151,510	10.76	608,587	28.29
(一)店頭市場(OTC)	1,672,189	7.42	1,429,704	7.15	242,485	16.96
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,605,679	7.12	1,402,938	7.02	202,741	14.45
3.買入選擇權(Bought Options)	28,807	0.13	15,200	0.08	13,607	89.52
4.賣出選擇權(Sold Options)	37,703	0.17	11,566	0.05	26,137	225.98
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,087,908	4.83	721,806	3.61	366,102	50.72
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	515,344	2.29	354,421	1.77	160,923	45.40
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	572,564	2.54	367,385	1.84	205,179	55.85
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)	19,666,033	87.27	17,752,945	88.82	1,913,088	10.78
(一)店頭市場(OTC)	19,663,175	87.26	17,748,360	88.80	1,914,815	10.79
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,377,165	6.11	1,336,679	6.69	40,486	3.03
2.換匯(Fx Swaps)	17,380,927	77.13	15,406,882	77.08	1,974,045	12.81
3.換匯換利(Currency Swaps)	84,750	0.38	104,092	0.52	-19,342	-18.58
4.買入選擇權(Bought Options)	407,342	1.81	440,823	2.21	-33,481	-7.60
5.賣出選擇權(Sold Options)	412,991	1.83	459,884	2.30	-46,893	-10.20
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,858	0.01	4,585	0.02	-1,727	-37.67
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,452	0.01	2,013	0.01	-561	-27.87
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,406	0.00	2,572	0.01	-1,166	-45.33
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)	99,748	0.44	74,036	0.37	25,712	34.73
(一)店頭市場(OTC)	7,583	0.03	7,873	0.04	-290	-3.68
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	92,165	0.41	66,163	0.33	26,002	39.30
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	7,361	0.03	5,418	0.03	1,943	35.86
(一)店頭市場(OTC)	4,446	0.02	3,663	0.02	783	21.38
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,915	0.01	1,755	0.01	1,160	66.10
小 計(一至四)	22,533,239	99.99	19,983,909	99.98	2,549,330	12.76
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,485	0.01	4,497	0.02	-3,012	-66.98
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,485	0.01	4,093	0.02	-2,608	-63.72
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	22,534,724	100.00	19,988,406	100.00	2,546,318	12.74

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。