

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)	1,657,566	1,514,687	3,172,253	12.64
(一)店頭市場(OTC)	1,657,566	431,515	2,089,081	8.32
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,083,172	1,083,172	4.32
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,177,126	14,619,886	21,797,012	86.87
(一)店頭市場(OTC)	7,177,126	14,618,447	21,795,573	86.86
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,439	1,439	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	78,515	31,821	110,336	0.44
(一)店頭市場(OTC)	-	4,415	4,415	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	78,515	27,406	105,921	0.42
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	11,161	11,161	0.04
(一)店頭市場(OTC)	-	8,441	8,441	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,720	2,720	0.01
小 計(一至四)	8,913,207	16,177,555	25,090,762	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,712	1,712	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	8,913,207	16,179,267	25,092,474	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3月	金 額	8,913,207	16,179,267	25,092,474
	比 重	35.52	64.48	100.00
114年2月	金 額	7,987,159	14,547,565	22,534,724
	比 重	35.44	64.56	100.00
比較增減	差 額	926,048	1,631,702	2,557,750
	變動率	11.59	11.22	11.35

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3月		114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)	3,172,253	12.64	2,760,097	12.25	412,156	14.93
(一)店頭市場(OTC)	2,089,081	8.32	1,672,189	7.42	416,892	24.93
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	2,051,923	8.17	1,605,679	7.12	446,244	27.79
3.買入選擇權(Bought Options)	11,986	0.05	28,807	0.13	-16,821	-58.39
4.賣出選擇權(Sold Options)	25,172	0.10	37,703	0.17	-12,531	-33.24
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,083,172	4.32	1,087,908	4.83	-4,736	-0.44
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	529,344	2.11	515,344	2.29	14,000	2.72
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	553,828	2.21	572,564	2.54	-18,736	-3.27
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)	21,797,012	86.87	19,666,033	87.27	2,130,979	10.84
(一)店頭市場(OTC)	21,795,573	86.86	19,663,175	87.26	2,132,398	10.84
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,541,872	6.14	1,377,165	6.11	164,707	11.96
2.換匯(Fx Swaps)	19,288,244	76.87	17,380,927	77.13	1,907,317	10.97
3.換匯換利(Currency Swaps)	96,469	0.38	84,750	0.38	11,719	13.83
4.買入選擇權(Bought Options)	428,243	1.71	407,342	1.81	20,901	5.13
5.賣出選擇權(Sold Options)	440,745	1.76	412,991	1.83	27,754	6.72
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,439	0.01	2,858	0.01	-1,419	-49.65
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	679	0.00	1,452	0.01	-773	-53.24
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	760	0.01	1,406	0.00	-646	-45.95
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)	110,336	0.44	99,748	0.44	10,588	10.61
(一)店頭市場(OTC)	4,415	0.02	7,583	0.03	-3,168	-41.78
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	105,921	0.42	92,165	0.41	13,756	14.93
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	11,161	0.04	7,361	0.03	3,800	51.62
(一)店頭市場(OTC)	8,441	0.03	4,446	0.02	3,995	89.86
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,720	0.01	2,915	0.01	-195	-6.69
小 計(一至四)	25,090,762	99.99	22,533,239	99.99	2,557,523	11.35
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,712	0.01	1,485	0.01	227	15.29
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,712	0.01	1,485	0.01	227	15.29
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	25,092,474	100.00	22,534,724	100.00	2,557,750	11.35

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。