

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)	1,583,430	840,132	2,423,562	11.75
(一)店頭市場(OTC)	1,583,430	241,644	1,825,074	8.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	598,488	598,488	2.90
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,727,915	12,363,554	18,091,469	87.71
(一)店頭市場(OTC)	5,727,915	12,360,198	18,088,113	87.69
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,356	3,356	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	79,376	21,325	100,701	0.49
(一)店頭市場(OTC)	150	7,170	7,320	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	79,226	14,155	93,381	0.45
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	11,029	11,029	0.05
(一)店頭市場(OTC)	-	8,594	8,594	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,435	2,435	0.01
小 計(一至四)	7,390,721	13,236,040	20,626,761	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	440	440	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,390,721	13,236,480	20,627,201	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12月	金 額	7,390,721	13,236,480	20,627,201
	比 重	35.83	64.17	100.00
114年11月	金 額	8,034,848	12,861,812	20,896,660
	比 重	38.45	61.55	100.00
比較增減	差 額	-644,127	374,668	-269,459
	變動率	-8.02	2.91	-1.29

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12月		114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)	2,423,562	11.75	2,968,619	14.21	-545,057	-18.36
(一)店頭市場(OTC)	1,825,074	8.85	2,290,004	10.96	-464,930	-20.30
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,765,908	8.56	2,260,988	10.82	-495,080	-21.90
3.買入選擇權(Bought Options)	26,526	0.13	12,422	0.06	14,104	113.54
4.賣出選擇權(Sold Options)	32,640	0.16	16,594	0.08	16,046	96.70
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	598,488	2.90	678,615	3.25	-80,127	-11.81
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	323,784	1.57	275,508	1.32	48,276	17.52
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	274,704	1.33	403,107	1.93	-128,403	-31.85
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)	18,091,469	87.71	17,796,513	85.16	294,956	1.66
(一)店頭市場(OTC)	18,088,113	87.69	17,793,137	85.14	294,976	1.66
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,860,103	9.02	1,655,377	7.92	204,726	12.37
2.換匯(Fx Swaps)	15,437,551	74.84	15,124,790	72.38	312,761	2.07
3.換匯換利(Currency Swaps)	30,459	0.15	39,484	0.19	-9,025	-22.86
4.買入選擇權(Bought Options)	381,549	1.85	482,976	2.31	-101,427	-21.00
5.賣出選擇權(Sold Options)	378,451	1.83	490,510	2.34	-112,059	-22.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,356	0.02	3,376	0.02	-20	-0.59
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,519	0.01	1,456	0.01	63	4.33
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,837	0.01	1,920	0.01	-83	-4.32
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)	100,701	0.49	109,514	0.53	-8,813	-8.05
(一)店頭市場(OTC)	7,320	0.04	6,736	0.04	584	8.67
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	93,381	0.45	102,778	0.49	-9,397	-9.14
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	11,029	0.05	19,598	0.09	-8,569	-43.72
(一)店頭市場(OTC)	8,594	0.04	10,996	0.05	-2,402	-21.84
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,435	0.01	8,602	0.04	-6,167	-71.69
小 計(一至四)	20,626,761	100.00	20,894,244	99.99	-267,483	-1.28
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	440	0.00	2,416	0.01	-1,976	-81.79
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	440	0.00	2,416	0.01	-1,976	-81.79
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	20,627,201	100.00	20,896,660	100.00	-269,459	-1.29

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。