

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商品種類別

115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)	1,966,510	1,240,491	3,207,001	14.58
(一)店頭市場(OTC)	1,966,510	450,707	2,417,217	10.99
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	789,784	789,784	3.59
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,624,401	11,930,232	18,554,633	84.35
(一)店頭市場(OTC)	6,624,401	11,927,045	18,551,446	84.33
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,187	3,187	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	155,393	58,662	214,055	0.97
(一)店頭市場(OTC)	141	10,966	11,107	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	155,252	47,696	202,948	0.92
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	21,831	21,831	0.10
(一)店頭市場(OTC)	-	15,593	15,593	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	6,238	6,238	0.03
小計(一至四)	8,746,304	13,251,216	21,997,520	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	472	472	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總計	8,746,304	13,251,688	21,997,992	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
115年1月	金額	8,746,304	13,251,688	21,997,992
	比重	39.76	60.24	100.00
114年12月	金額	7,390,721	13,236,480	20,627,201
	比重	35.83	64.17	100.00
比較增減	差額	1,355,583	15,208	1,370,791
	變動率	18.34	0.11	6.65

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	115年1月		114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)	3,207,001	14.58	2,423,562	11.75	783,439	32.33
(一)店頭市場(OTC)	2,417,217	10.99	1,825,074	8.85	592,143	32.44
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	2,289,530	10.41	1,765,908	8.56	523,622	29.65
3.買入選擇權(Bought Options)	64,720	0.29	26,526	0.13	38,194	143.99
4.賣出選擇權(Sold Options)	62,967	0.29	32,640	0.16	30,327	92.91
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	789,784	3.59	598,488	2.90	191,296	31.96
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	435,646	1.98	323,784	1.57	111,862	34.55
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	354,138	1.61	274,704	1.33	79,434	28.92
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)	18,554,633	84.35	18,091,469	87.71	463,164	2.56
(一)店頭市場(OTC)	18,551,446	84.33	18,088,113	87.69	463,333	2.56
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,133,903	5.15	1,860,103	9.02	-726,200	-39.04
2.換匯(Fx Swaps)	16,274,661	73.98	15,437,551	74.84	837,110	5.42
3.換匯換利(Currency Swaps)	103,016	0.47	30,459	0.15	72,557	238.21
4.買入選擇權(Bought Options)	508,289	2.31	381,549	1.85	126,740	33.22
5.賣出選擇權(Sold Options)	531,577	2.42	378,451	1.83	153,126	40.46
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,187	0.02	3,356	0.02	-169	-5.04
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,846	0.01	1,519	0.01	327	21.53
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,341	0.01	1,837	0.01	-496	-27.00
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)	214,055	0.97	100,701	0.49	113,354	112.56
(一)店頭市場(OTC)	11,107	0.05	7,320	0.04	3,787	51.73
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	202,948	0.92	93,381	0.45	109,567	117.33
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	21,831	0.10	11,029	0.05	10,802	97.94
(一)店頭市場(OTC)	15,593	0.07	8,594	0.04	6,999	81.44
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,238	0.03	2,435	0.01	3,803	156.18
小計(一至四)	21,997,520	100.00	20,626,761	100.00	1,370,759	6.65
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	472	0.00	440	0.00	32	7.27
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	472	0.00	440	0.00	32	7.27
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	21,997,992	100.00	20,627,201	100.00	1,370,791	6.65

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。