

# 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
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	<b>1,241,178</b>	<b>962,178</b>	<b>2,203,356</b>	<b>13.82</b>
(一)店頭市場(OTC)	1,241,178	315,290	1,556,468	9.76
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	646,888	646,888	4.06
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	<b>5,110,937</b>	<b>8,443,153</b>	<b>13,554,090</b>	<b>85.02</b>
(一)店頭市場(OTC)	5,110,937	8,439,893	13,550,830	85.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,260	3,260	0.02
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	<b>140,753</b>	<b>32,733</b>	<b>173,486</b>	<b>1.09</b>
(一)店頭市場(OTC)	110	5,575	5,685	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	140,643	27,158	167,801	1.05
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>10,793</b>	<b>10,793</b>	<b>0.07</b>
(一)店頭市場(OTC)	-	9,825	9,825	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	968	968	0.01
<b>小計(一至四)</b>	<b>6,492,868</b>	<b>9,448,857</b>	<b>15,941,725</b>	<b>100.00</b>
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>938</b>	<b>938</b>	<b>0.00</b>
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>總計</b>	<b>6,492,868</b>	<b>9,449,795</b>	<b>15,942,663</b>	<b>100.00</b>

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2月	金額	6,492,868	9,449,795	15,942,663
	比重	40.73	59.27	100.00
115年1月	金額	8,746,304	13,251,688	21,997,992
	比重	39.76	60.24	100.00
比較增減	差額	-2,253,436	-3,801,893	-6,055,329
	變動率	-25.76	-28.69	-27.53

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2月		115年1月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差額	變動率
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	<b>2,203,356</b>	<b>13.82</b>	<b>3,207,001</b>	<b>14.58</b>	<b>-1,003,645</b>	<b>-31.30</b>
(一)店頭市場(OTC)	1,556,468	9.76	2,417,217	10.99	-860,749	-35.61
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,414,490	8.87	2,289,530	10.41	-875,040	-38.22
3.買入選擇權(Bought Options)	78,756	0.49	64,720	0.29	14,036	21.69
4.賣出選擇權(Sold Options)	63,222	0.40	62,967	0.29	255	0.40
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	646,888	4.06	789,784	3.59	-142,896	-18.09
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	293,869	1.84	435,646	1.98	-141,777	-32.54
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	353,019	2.22	354,138	1.61	-1,119	-0.32
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	<b>13,554,090</b>	<b>85.02</b>	<b>18,554,633</b>	<b>84.35</b>	<b>-5,000,543</b>	<b>-26.95</b>
(一)店頭市場(OTC)	13,550,830	85.00	18,551,446	84.33	-5,000,616	-26.96
1.遠期契約(Outright Forwards)	759,667	4.77	1,133,903	5.15	-374,236	-33.00
2.換匯(Fx Swaps)	12,112,171	75.97	16,274,661	73.98	-4,162,490	-25.58
3.換匯換利(Currency Swaps)	51,395	0.32	103,016	0.47	-51,621	-50.11
4.買入選擇權(Bought Options)	309,130	1.94	508,289	2.31	-199,159	-39.18
5.賣出選擇權(Sold Options)	318,467	2.00	531,577	2.42	-213,110	-40.09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,260	0.02	3,187	0.02	73	2.29
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,206	0.01	1,846	0.01	360	19.50
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,054	0.01	1,341	0.01	-287	-21.40
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	<b>173,486</b>	<b>1.09</b>	<b>214,055</b>	<b>0.97</b>	<b>-40,569</b>	<b>-18.95</b>
(一)店頭市場(OTC)	5,685	0.04	11,107	0.05	-5,422	-48.82
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	167,801	1.05	202,948	0.92	-35,147	-17.32
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	<b>10,793</b>	<b>0.07</b>	<b>21,831</b>	<b>0.10</b>	<b>-11,038</b>	<b>-50.56</b>
(一)店頭市場(OTC)	9,825	0.06	15,593	0.07	-5,768	-36.99
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	968	0.01	6,238	0.03	-5,270	-84.48
<b>小計(一至四)</b>	<b>15,941,725</b>	<b>100.00</b>	<b>21,997,520</b>	<b>100.00</b>	<b>-6,055,795</b>	<b>-27.53</b>
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	<b>938</b>	<b>0.00</b>	<b>472</b>	<b>0.00</b>	<b>466</b>	<b>98.73</b>
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	938	0.00	472	0.00	466	98.73
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)	-	-	-	-	-	-
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
1.遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2.交換(Swaps)	-	-	-	-	-	-
3.選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
<b>總計</b>	<b>15,942,663</b>	<b>100.00</b>	<b>21,997,992</b>	<b>100.00</b>	<b>-6,055,329</b>	<b>-27.53</b>

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。