

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)	5,163,818	1,929,535	7,093,353	25.72
(一)店頭市場(OTC)	5,163,818	529,884	5,693,702	20.64
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	1,399,651	1,399,651	5.07
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Contracts)	7,579,907	12,601,686	20,181,593	73.17
(一)店頭市場(OTC)	7,579,907	12,595,875	20,175,782	73.15
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	5,811	5,811	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-Linked Contracts)	231,233	52,694	283,927	1.03
(一)店頭市場(OTC)	290	7,598	7,888	0.03
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	230,943	45,096	276,039	1.00
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	20,204	20,204	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	17,737	17,737	0.06
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	2,467	2,467	0.01
小計(一至四)	12,974,958	14,604,119	27,579,077	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,239	2,239	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總計	12,974,958	14,606,358	27,581,316	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3月	金額	12,974,958	14,606,358	27,581,316
	比重	47.04	52.96	100.00
115年2月	金額	6,492,868	9,449,795	15,942,663
	比重	40.73	59.27	100.00
比較增減	差額	6,482,090	5,156,563	11,638,653
	變動率	99.83	54.57	73.00

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3月		115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)	7,093,353	25.72	2,203,356	13.82	4,889,997	221.93
(一)店頭市場(OTC)	5,693,702	20.64	1,556,468	9.76	4,137,234	265.81
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	5,581,667	20.24	1,414,490	8.87	4,167,177	294.61
3.買入選擇權(Bought Options)	62,490	0.23	78,756	0.49	-16,266	-20.65
4.賣出選擇權(Sold Options)	49,545	0.18	63,222	0.40	-13,677	-21.63
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	1,399,651	5.07	646,888	4.06	752,763	116.37
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	681,441	2.47	293,869	1.84	387,572	131.89
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	718,210	2.60	353,019	2.22	365,191	103.45
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 Contracts)	20,181,593	73.17	13,554,090	85.02	6,627,503	48.90
(一)店頭市場(OTC)	20,175,782	73.15	13,550,830	85.00	6,624,952	48.89
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,274,327	4.62	759,667	4.77	514,660	67.75
2.換匯(FX Swaps)	17,506,367	63.47	12,112,171	75.97	5,394,196	44.54
3.換匯換利(Currency Swaps)	121,708	0.44	51,395	0.32	70,313	136.81
4.買入選擇權(Bought Options)	629,425	2.28	309,130	1.94	320,295	103.61
5.賣出選擇權(Sold Options)	643,955	2.33	318,467	2.00	325,488	102.20
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	5,811	0.02	3,260	0.02	2,551	78.25
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,521	0.01	2,206	0.01	315	14.28
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	3,290	0.01	1,054	0.01	2,236	212.14
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)	283,927	1.03	173,486	1.09	110,441	63.66
(一)店頭市場(OTC)	7,888	0.03	5,685	0.04	2,203	38.75
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	276,039	1.00	167,801	1.05	108,238	64.50
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	20,204	0.07	10,793	0.07	9,411	87.20
(一)店頭市場(OTC)	17,737	0.06	9,825	0.06	7,912	80.53
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	2,467	0.01	968	0.01	1,499	154.86
小計(一至四)	27,579,077	99.99	15,941,725	100.00	11,637,352	73.00
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	2,239	0.01	938	0.00	1,301	138.70
1.信用違約交換(Credit Default Swaps)	2,239	0.01	938	0.00	1,301	138.70
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(Others)	-	-	-	-	-	-
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	27,581,316	100.00	15,942,663	100.00	11,638,653	73.00

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。