

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

110年11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)	346,337	1,675,847	2,022,184	16.18
(一)店頭市場(OTC)	346,337	219,946	566,283	4.53
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,455,901	1,455,901	11.65
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,857,252	5,514,919	10,372,171	82.99
(一)店頭市場(OTC)	4,857,252	5,512,829	10,370,081	82.97
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,090	2,090	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	84,282	6,460	90,742	0.73
(一)店頭市場(OTC)	399	1,054	1,453	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	83,883	5,406	89,289	0.72
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	10,542	10,542	0.08
(一)店頭市場(OTC)	-	8,467	8,467	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,075	2,075	0.01
小 計(一至四)	5,287,871	7,207,768	12,495,639	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,225	2,225	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,287,871	7,209,993	12,497,864	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
110年11月	金 額	5,287,871	7,209,993	12,497,864
	比 重	42.31	57.69	100.00
110年10月	金 額	5,836,162	r 6,974,616	r 12,810,778
	比 重	r 45.56	r 54.44	100.00
比較增減	差 額	-548,291	235,377	-312,914
	變動率	-9.39	3.37	-2.44

註：r為修正數。

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	110年11月		110年10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)	2,022,184	16.18	r 1,916,993	14.96	105,191	5.49
(一)店頭市場(OTC)	566,283	4.53	r 1,230,652	9.60	-664,369	-53.99
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	530,386	4.24	r 1,097,079	8.56	-566,693	-51.65
3.買入選擇權(Bought Options)	15,672	0.13	r 55,370	0.43	-39,698	-71.70
4.賣出選擇權(Sold Options)	20,225	0.16	r 78,203	0.61	-57,978	-74.14
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,455,901	11.65	686,341	5.36	769,560	112.13
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	738,435	5.91	335,717	2.62	402,718	119.96
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	717,077	5.74	350,624	2.74	366,453	104.51
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	389	0.00	-	-	389	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,372,171	82.99	10,764,150	84.03	-391,979	-3.64
(一)店頭市場(OTC)	10,370,081	82.97	10,756,678	83.97	-386,597	-3.59
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,030,555	8.24	1,091,612	8.52	-61,057	-5.59
2.換匯(Fx Swaps)	8,839,457	70.73	9,051,227	70.65	-211,770	-2.34
3.換匯換利(Currency Swaps)	30,256	0.24	65,681	0.51	-35,425	-53.93
4.買入選擇權(Bought Options)	232,977	1.86	276,069	2.16	-43,092	-15.61
5.賣出選擇權(Sold Options)	236,836	1.90	272,089	2.13	-35,253	-12.96
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,090	0.02	7,472	0.06	-5,382	-72.03
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,230	0.01	3,589	0.03	-2,359	-65.73
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	860	0.01	3,883	0.03	-3,023	-77.85
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)	90,742	0.73	119,751	0.94	-29,009	-24.22
(一)店頭市場(OTC)	1,453	0.01	1,886	0.02	-433	-22.96
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	89,289	0.72	117,865	0.92	-28,576	-24.24
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,542	0.08	8,076	0.06	2,466	30.53
(一)店頭市場(OTC)	8,467	0.07	6,200	0.05	2,267	36.56
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,075	0.01	1,876	0.01	199	10.61
小計(一至四)	12,495,639	99.98	r 12,808,970	99.99	-313,331	-2.45
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,225	0.02	1,808	0.01	417	23.06
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,225	0.02	1,808	0.01	417	23.06
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	12,497,864	100.00	r 12,810,778	100.00	-312,914	-2.44

註：1.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。

2. r為修正數。