

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)	207,526	1,043,274	1,250,800	10.41
(一)店頭市場(OTC)	207,526	210,661	418,187	3.48
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	832,613	832,613	6.93
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,026,221	5,650,999	10,677,220	88.88
(一)店頭市場(OTC)	5,026,221	5,644,814	10,671,035	88.83
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	6,185	6,185	0.05
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	69,187	6,196	75,383	0.63
(一)店頭市場(OTC)	292	230	522	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	68,895	5,966	74,861	0.62
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	9,068	9,068	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	8,676	8,676	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	392	392	0.00
小 計(一至四)	5,302,934	6,709,537	12,012,471	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	535	535	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,302,934	6,710,072	12,013,006	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12月	金 額	5,302,934	6,710,072	12,013,006
	比 重	44.14	55.86	100.00
110年11月	金 額	5,287,871	7,209,993	12,497,864
	比 重	42.31	57.69	100.00
比較增減	差 額	15,063	-499,921	-484,858
	變 動 率	0.28	-6.93	-3.88

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12月		110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)	1,250,800	10.41	2,022,184	16.18	-771,384	-38.15
(一)店頭市場(OTC)	418,187	3.48	566,283	4.53	-148,096	-26.15
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	373,872	3.11	530,386	4.24	-156,514	-29.51
3.買入選擇權(Bought Options)	4,380	0.04	15,672	0.13	-11,292	-72.05
4.賣出選擇權(Sold Options)	39,935	0.33	20,225	0.16	19,710	97.45
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	832,613	6.93	1,455,901	11.65	-623,288	-42.81
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	392,061	3.26	738,435	5.91	-346,374	-46.91
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	440,552	3.67	717,077	5.74	-276,525	-38.56
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	389	0.00	-389	-100.00
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	10,677,220	88.88	10,372,171	82.99	305,049	2.94
(一)店頭市場(OTC)	10,671,035	88.83	10,370,081	82.97	300,954	2.90
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,009,995	8.41	1,030,555	8.24	-20,560	-2.00
2.換匯(Fx Swaps)	9,315,012	77.54	8,839,457	70.73	475,555	5.38
3.換匯換利(Currency Swaps)	45,404	0.38	30,256	0.24	15,148	50.07
4.買入選擇權(Bought Options)	150,775	1.25	232,977	1.86	-82,202	-35.28
5.賣出選擇權(Sold Options)	149,849	1.25	236,836	1.90	-86,987	-36.73
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,185	0.05	2,090	0.02	4,095	195.93
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	3,113	0.03	1,230	0.01	1,883	153.09
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	3,072	0.02	860	0.01	2,212	257.21
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)	75,383	0.63	90,742	0.73	-15,359	-16.93
(一)店頭市場(OTC)	522	0.01	1,453	0.01	-931	-64.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	74,861	0.62	89,289	0.72	-14,428	-16.16
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	9,068	0.07	10,542	0.08	-1,474	-13.98
(一)店頭市場(OTC)	8,676	0.07	8,467	0.07	209	2.47
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	392	0.00	2,075	0.01	-1,683	-81.11
小計(一至四)	12,012,471	99.99	12,495,639	99.98	-483,168	-3.87
五、信用有關契約(Credit Contracts)	535	0.01	2,225	0.02	-1,690	-75.96
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	535	0.01	2,225	0.02	-1,690	-75.96
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	12,013,006	100.00	12,497,864	100.00	-484,858	-3.88

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。