

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

111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)	433,591	1,092,380	1,525,971	11.22
(一)店頭市場(OTC)	433,591	271,144	704,735	5.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	821,236	821,236	6.04
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,527,353	6,416,338	11,943,691	87.84
(一)店頭市場(OTC)	5,527,353	6,410,474	11,937,827	87.80
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	5,864	5,864	0.04
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	95,676	22,090	117,766	0.86
(一)店頭市場(OTC)	104	1,795	1,899	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	95,572	20,295	115,867	0.85
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	7,666	7,666	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	6,980	6,980	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	686	686	0.01
小 計(一至四)	6,056,620	7,538,474	13,595,094	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,549	2,549	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,056,620	7,541,023	13,597,643	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
111年1月	金 額	6,056,620	7,541,023	13,597,643
	比 重	44.54	55.46	100.00
110年12月	金 額	5,302,934	6,710,072	12,013,006
	比 重	44.14	55.86	100.00
比較增減	差 額	753,686	830,951	1,584,637
	變動率	14.21	12.38	13.19

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	111年1月		110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)	1,525,971	11.22	1,250,800	10.41	275,171	22.00
(一)店頭市場(OTC)	704,735	5.18	418,187	3.48	286,548	68.52
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	652,955	4.80	373,872	3.11	279,083	74.65
3.買入選擇權(Bought Options)	20,766	0.15	4,380	0.04	16,386	374.11
4.賣出選擇權(Sold Options)	31,014	0.23	39,935	0.33	-8,921	-22.34
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	821,236	6.04	832,613	6.93	-11,377	-1.37
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	392,054	2.88	392,061	3.26	-7	0.00
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	427,804	3.15	440,552	3.67	-12,748	-2.89
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	1,378	0.01	-	-	1,378	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	11,943,691	87.84	10,677,220	88.88	1,266,471	11.86
(一)店頭市場(OTC)	11,937,827	87.80	10,671,035	88.83	1,266,792	11.87
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,043,017	7.67	1,009,995	8.41	33,022	3.27
2.換匯(Fx Swaps)	10,269,569	75.53	9,315,012	77.54	954,557	10.25
3.換匯換利(Currency Swaps)	42,221	0.31	45,404	0.38	-3,183	-7.01
4.買入選擇權(Bought Options)	291,556	2.15	150,775	1.25	140,781	93.37
5.賣出選擇權(Sold Options)	291,464	2.14	149,849	1.25	141,615	94.51
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,864	0.04	6,185	0.05	-321	-5.19
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,852	0.02	3,113	0.03	-261	-8.38
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	3,012	0.02	3,072	0.02	-60	-1.95
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)	117,766	0.86	75,383	0.63	42,383	56.22
(一)店頭市場(OTC)	1,899	0.01	522	0.01	1,377	263.79
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	115,867	0.85	74,861	0.62	41,006	54.78
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	7,666	0.06	9,068	0.07	-1,402	-15.46
(一)店頭市場(OTC)	6,980	0.05	8,676	0.07	-1,696	-19.55
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	686	0.01	392	0.00	294	75.00
小 計(一至四)	13,595,094	99.98	12,012,471	99.99	1,582,623	13.17
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,549	0.02	535	0.01	2,014	376.45
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,549	0.02	535	0.01	2,014	376.45
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	13,597,643	100.00	12,013,006	100.00	1,584,637	13.19

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。