

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10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)	315,057	944,691	1,259,748	8.22
(一)店頭市場(OTC)	315,057	242,011	557,068	3.63
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	702,680	702,680	4.59
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,993,486	6,926,053	13,919,539	90.85
(一)店頭市場(OTC)	6,993,486	6,921,501	13,914,987	90.82
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,552	4,552	0.03
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	116,448	15,952	132,400	0.86
(一)店頭市場(OTC)	10	1,394	1,404	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	116,438	14,558	130,996	0.85
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	10,419	10,419	0.07
(一)店頭市場(OTC)	-	8,481	8,481	0.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,938	1,938	0.01
小 計(一至四)	7,424,991	7,897,115	15,322,106	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	250	250	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,424,991	7,897,365	15,322,356	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10月	金 額	7,424,991	7,897,365	15,322,356
	比 重	48.46	51.54	100.00
111年9月	金 額	8,299,515	9,041,943	17,341,458
	比 重	47.86	52.14	100.00
比較增減	差 額	-874,524	-1,144,578	-2,019,102
	變動率	-10.54	-12.66	-11.64

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10月		111年9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)	1,259,748	8.22	2,208,851	12.74	-949,103	-42.97
(一)店頭市場(OTC)	557,068	3.63	885,069	5.11	-328,001	-37.06
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	503,493	3.29	852,503	4.92	-349,010	-40.94
3.買入選擇權(Bought Options)	22,184	0.14	14,698	0.09	7,486	50.93
4.賣出選擇權(Sold Options)	31,391	0.20	17,868	0.10	13,523	75.68
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	702,680	4.59	1,323,782	7.63	-621,102	-46.92
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	360,942	2.36	694,945	4.01	-334,003	-48.06
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	341,738	2.23	628,837	3.62	-287,099	-45.66
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 Transactions)	13,919,539	90.85	14,908,263	85.97	-988,724	-6.63
(一)店頭市場(OTC)	13,914,987	90.82	14,902,220	85.93	-987,233	-6.62
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,307,858	8.54	1,677,679	9.67	-369,821	-22.04
2.換匯(Fx Swaps)	12,073,943	78.80	12,589,863	72.60	-515,920	-4.10
3.換匯換利(Currency Swaps)	17,324	0.11	76,222	0.44	-58,898	-77.27
4.買入選擇權(Bought Options)	257,885	1.68	276,718	1.60	-18,833	-6.81
5.賣出選擇權(Sold Options)	257,977	1.69	281,738	1.62	-23,761	-8.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,552	0.03	6,043	0.04	-1,491	-24.67
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,940	0.02	3,631	0.02	-691	-19.03
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,612	0.01	2,412	0.02	-800	-33.17
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)	132,400	0.86	214,163	1.23	-81,763	-38.18
(一)店頭市場(OTC)	1,404	0.01	362	0.00	1,042	287.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	130,996	0.85	213,801	1.23	-82,805	-38.73
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	10,419	0.07	8,863	0.05	1,556	17.56
(一)店頭市場(OTC)	8,481	0.06	6,682	0.04	1,799	26.92
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,938	0.01	2,181	0.01	-243	-11.14
小 計(一至四)	15,322,106	100.00	17,340,140	99.99	-2,018,034	-11.64
五、信用有關契約(Credit Contracts)	250	0.00	1,318	0.01	-1,068	-81.03
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	250	0.00	1,318	0.01	-1,068	-81.03
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	15,322,356	100.00	17,341,458	100.00	-2,019,102	-11.64

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。