

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)	381,922	967,527	1,349,449	8.78
(一)店頭市場(OTC)	381,922	193,559	575,481	3.74
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	773,968	773,968	5.04
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,917,913	6,976,734	13,894,647	90.38
(一)店頭市場(OTC)	6,917,913	6,971,768	13,889,681	90.35
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,966	4,966	0.03
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	109,168	12,690	121,858	0.79
(一)店頭市場(OTC)	1	1,752	1,753	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	109,167	10,938	120,105	0.78
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	6,513	6,513	0.04
(一)店頭市場(OTC)	-	4,231	4,231	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,282	2,282	0.01
小 計(一至四)	7,409,003	7,963,464	15,372,467	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	682	682	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,409,003	7,964,146	15,373,149	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11月	金 額	7,409,003	7,964,146	15,373,149
	比 重	48.19	51.81	100.00
111年10月	金 額	7,424,991	7,897,365	15,322,356
	比 重	48.46	51.54	100.00
比較增減	差 額	-15,988	66,781	50,793
	變動率	-0.22	0.85	0.33

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11月		111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)	1,349,449	8.78	1,259,748	8.22	89,701	7.12
(一)店頭市場(OTC)	575,481	3.74	557,068	3.63	18,413	3.31
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	525,163	3.41	503,493	3.29	21,670	4.30
3.買入選擇權(Bought Options)	17,850	0.12	22,184	0.14	-4,334	-19.54
4.賣出選擇權(Sold Options)	32,468	0.21	31,391	0.20	1,077	3.43
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	773,968	5.04	702,680	4.59	71,288	10.15
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	350,897	2.29	360,942	2.36	-10,045	-2.78
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	423,071	2.75	341,738	2.23	81,333	23.80
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)	13,894,647	90.38	13,919,539	90.85	-24,892	-0.18
(一)店頭市場(OTC)	13,889,681	90.35	13,914,987	90.82	-25,306	-0.18
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,341,672	8.73	1,307,858	8.54	33,814	2.59
2.換匯(Fx Swaps)	12,093,480	78.66	12,073,943	78.80	19,537	0.16
3.換匯換利(Currency Swaps)	21,438	0.14	17,324	0.11	4,114	23.75
4.買入選擇權(Bought Options)	216,736	1.41	257,885	1.68	-41,149	-15.96
5.賣出選擇權(Sold Options)	216,355	1.41	257,977	1.69	-41,622	-16.13
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,966	0.03	4,552	0.03	414	9.09
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,171	0.01	2,940	0.02	-769	-26.16
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,795	0.02	1,612	0.01	1,183	73.39
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)	121,858	0.79	132,400	0.86	-10,542	-7.96
(一)店頭市場(OTC)	1,753	0.01	1,404	0.01	349	24.86
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	120,105	0.78	130,996	0.85	-10,891	-8.31
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	6,513	0.04	10,419	0.07	-3,906	-37.49
(一)店頭市場(OTC)	4,231	0.03	8,481	0.06	-4,250	-50.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,282	0.01	1,938	0.01	344	17.75
小 計(一至四)	15,372,467	99.99	15,322,106	100.00	50,361	0.33
五、信用有關契約(Credit Contracts)	682	0.01	250	0.00	432	172.80
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	682	0.01	250	0.00	432	172.80
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	15,373,149	100.00	15,322,356	100.00	50,793	0.33

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。