

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)	331,278	708,416	1,039,694	7.08
(一)店頭市場(OTC)	331,278	200,541	531,819	3.62
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	507,875	507,875	3.46
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,779,294	6,824,171	13,603,465	92.63
(一)店頭市場(OTC)	6,779,294	6,821,077	13,600,371	92.61
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,094	3,094	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	30,678	6,628	37,306	0.26
(一)店頭市場(OTC)	-	2,464	2,464	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	30,678	4,164	34,842	0.24
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	4,620	4,620	0.03
(一)店頭市場(OTC)	-	3,689	3,689	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	931	931	0.01
小計(一至四)	7,141,250	7,543,835	14,685,085	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	373	373	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總計	7,141,250	7,544,208	14,685,458	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12月	金額	7,141,250	7,544,208	14,685,458
	比重	48.63	51.37	100.00
111年11月	金額	7,409,003	7,964,146	15,373,149
	比重	48.19	51.81	100.00
比較增減	差額	-267,753	-419,938	-687,691
	變動率	-3.61	-5.27	-4.47

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12月		111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)	1,039,694	7.08	1,349,449	8.78	-309,755	-22.95
(一)店頭市場(OTC)	531,819	3.62	575,481	3.74	-43,662	-7.59
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	509,348	3.47	525,163	3.41	-15,815	-3.01
3.買入選擇權(Bought Options)	10,510	0.07	17,850	0.12	-7,340	-41.12
4.賣出選擇權(Sold Options)	11,961	0.08	32,468	0.21	-20,507	-63.16
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	507,875	3.46	773,968	5.04	-266,093	-34.38
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	262,112	1.79	350,897	2.29	-88,785	-25.30
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	245,763	1.67	423,071	2.75	-177,308	-41.91
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)	13,603,465	92.63	13,894,647	90.38	-291,182	-2.10
(一)店頭市場(OTC)	13,600,371	92.61	13,889,681	90.35	-289,310	-2.08
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,210,540	8.24	1,341,672	8.73	-131,132	-9.77
2.換匯(Fx Swaps)	12,084,114	82.29	12,093,480	78.66	-9,366	-0.08
3.換匯換利(Currency Swaps)	29,971	0.20	21,438	0.14	8,533	39.80
4.買入選擇權(Bought Options)	139,355	0.95	216,736	1.41	-77,381	-35.70
5.賣出選擇權(Sold Options)	136,391	0.93	216,355	1.41	-79,964	-36.96
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,094	0.02	4,966	0.03	-1,872	-37.70
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,166	0.01	2,171	0.01	-1,005	-46.29
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,928	0.01	2,795	0.02	-867	-31.02
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)	37,306	0.26	121,858	0.79	-84,552	-69.39
(一)店頭市場(OTC)	2,464	0.02	1,753	0.01	711	40.56
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	34,842	0.24	120,105	0.78	-85,263	-70.99
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	4,620	0.03	6,513	0.04	-1,893	-29.06
(一)店頭市場(OTC)	3,689	0.02	4,231	0.03	-542	-12.81
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	931	0.01	2,282	0.01	-1,351	-59.20
小計(一至四)	14,685,085	100.00	15,372,467	99.99	-687,382	-4.47
五、信用有關契約(Credit Contracts)	373	0.00	682	0.01	-309	-45.31
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	373	0.00	682	0.01	-309	-45.31
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	14,685,458	100.00	15,373,149	100.00	-687,691	-4.47

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。