

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

112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)	704,592	1,244,245	1,948,837	9.94
(一)店頭市場(OTC)	704,592	214,415	919,007	4.69
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,029,830	1,029,830	5.25
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,219,040	10,339,084	17,558,124	89.54
(一)店頭市場(OTC)	7,219,040	10,334,357	17,553,397	89.51
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,727	4,727	0.03
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	73,681	21,413	95,094	0.48
(一)店頭市場(OTC)	-	2,795	2,795	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	73,681	18,618	92,299	0.47
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	7,011	7,011	0.04
(一)店頭市場(OTC)	-	2,509	2,509	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,502	4,502	0.03
小 計(一至四)	7,997,313	11,611,753	19,609,066	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	706	706	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,997,313	11,612,459	19,609,772	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
112年11月	金 額	7,997,313	11,612,459	19,609,772
	比 重	40.78	59.22	100.00
112年10月	金 額	7,066,277	9,602,589	16,668,866
	比 重	42.39	57.61	100.00
比較增減	差 額	931,036	2,009,870	2,940,906
	變動率	13.18	20.93	17.64

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	112年11月		112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)	1,948,837	9.94	1,653,996	9.92	294,841	17.83
(一)店頭市場(OTC)	919,007	4.69	651,951	3.91	267,056	40.96
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	865,143	4.41	637,692	3.82	227,451	35.67
3.買入選擇權(Bought Options)	20,599	0.11	4,438	0.03	16,161	364.15
4.賣出選擇權(Sold Options)	33,265	0.17	9,821	0.06	23,444	238.71
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,029,830	5.25	1,002,045	6.01	27,785	2.77
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	515,763	2.63	499,959	3.00	15,804	3.16
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	514,067	2.62	502,086	3.01	11,981	2.39
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)	17,558,124	89.54	14,900,582	89.39	2,657,542	17.84
(一)店頭市場(OTC)	17,553,397	89.51	14,898,357	89.38	2,655,040	17.82
1.遠期契約(Outright Forwards)	2,314,473	11.80	1,440,015	8.64	874,458	60.73
2.換匯(Fx Swaps)	14,318,613	73.02	12,493,756	74.95	1,824,857	14.61
3.換匯換利(Currency Swaps)	64,437	0.33	45,555	0.27	18,882	41.45
4.買入選擇權(Bought Options)	431,609	2.20	459,863	2.76	-28,254	-6.14
5.賣出選擇權(Sold Options)	424,265	2.16	459,168	2.76	-34,903	-7.60
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,727	0.03	2,225	0.01	2,502	112.45
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,918	0.02	873	0.00	2,045	234.25
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,809	0.01	1,352	0.01	457	33.80
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)	95,094	0.48	102,874	0.62	-7,780	-7.56
(一)店頭市場(OTC)	2,795	0.01	2,571	0.02	224	8.71
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	92,299	0.47	100,303	0.60	-8,004	-7.98
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	7,011	0.04	10,065	0.06	-3,054	-30.34
(一)店頭市場(OTC)	2,509	0.01	3,916	0.02	-1,407	-35.93
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,502	0.03	6,149	0.04	-1,647	-26.78
小 計(一至四)	19,609,066	100.00	16,667,517	99.99	2,941,549	17.65
五、信用有關契約(Credit Contracts)	706	0.00	1,349	0.01	-643	-47.66
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	706	0.00	1,349	0.01	-643	-47.66
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	19,609,772	100.00	16,668,866	100.00	2,940,906	17.64

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。