

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

113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)	802,708	1,322,451	2,125,159	8.88
(一)店頭市場(OTC)	802,708	280,493	1,083,201	4.53
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,041,958	1,041,958	4.35
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	7,360,708	14,348,010	21,708,718	90.74
(一)店頭市場(OTC)	7,360,708	14,344,090	21,704,798	90.72
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,920	3,920	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	59,278	22,760	82,038	0.34
(一)店頭市場(OTC)	-	5,367	5,367	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	59,278	17,393	76,671	0.32
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	8,826	8,826	0.04
(一)店頭市場(OTC)	-	5,905	5,905	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,921	2,921	0.01
小 計(一至四)	8,222,694	15,702,047	23,924,741	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	325	325	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	8,222,694	15,702,372	23,925,066	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
113年11月	金 額	8,222,694	15,702,372	23,925,066
	比 重	34.37	65.63	100.00
113年10月	金 額	7,885,560	14,184,396	22,069,956
	比 重	35.73	64.27	100.00
比較增減	差 額	337,134	1,517,976	1,855,110
	變動率	4.28	10.70	8.41

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	113年11月		113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)	2,125,159	8.88	2,366,089	10.72	-240,930	-10.18
(一)店頭市場(OTC)	1,083,201	4.53	1,520,890	6.89	-437,689	-28.78
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,048,384	4.38	1,496,370	6.78	-447,986	-29.94
3.買入選擇權(Bought Options)	12,596	0.05	7,175	0.03	5,421	75.55
4.賣出選擇權(Sold Options)	22,221	0.10	17,345	0.08	4,876	28.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,041,958	4.35	845,199	3.83	196,759	23.28
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	532,811	2.22	328,703	1.49	204,108	62.09
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	509,147	2.13	516,496	2.34	-7,349	-1.42
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)	21,708,718	90.74	19,618,225	88.89	2,090,493	10.66
(一)店頭市場(OTC)	21,704,798	90.72	19,615,232	88.88	2,089,566	10.65
1.遠期契約(Outright Forwards)	2,484,072	10.38	2,455,440	11.13	28,632	1.17
2.換匯(Fx Swaps)	18,222,546	76.17	16,137,897	73.12	2,084,649	12.92
3.換匯換利(Currency Swaps)	58,075	0.24	54,775	0.25	3,300	6.02
4.買入選擇權(Bought Options)	465,756	1.95	482,805	2.19	-17,049	-3.53
5.賣出選擇權(Sold Options)	474,349	1.98	484,315	2.19	-9,966	-2.06
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,920	0.02	2,993	0.01	927	30.97
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,573	0.01	1,656	0.01	-83	-5.01
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,347	0.01	1,337	0.00	1,010	75.54
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)	82,038	0.34	73,934	0.34	8,104	10.96
(一)店頭市場(OTC)	5,367	0.02	4,999	0.03	368	7.36
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	76,671	0.32	68,935	0.31	7,736	11.22
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	8,826	0.04	9,362	0.04	-536	-5.73
(一)店頭市場(OTC)	5,905	0.03	6,914	0.03	-1,009	-14.59
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,921	0.01	2,448	0.01	473	19.32
小 計(一至四)	23,924,741	100.00	22,067,610	99.99	1,857,131	8.42
五、信用有關契約(Credit Contracts)	325	0.00	2,346	0.01	-2,021	-86.15
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	325	0.00	2,242	0.01	-1,917	-85.50
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)	-	-	104	0.00	-104	-100.00
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	23,925,066	100.00	22,069,956	100.00	1,855,110	8.41

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。