

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表
商 品 種 類 別

114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)	1,879,874	1,088,745	2,968,619	14.21
(一)店頭市場(OTC)	1,879,874	410,130	2,290,004	10.96
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	678,615	678,615	3.25
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,071,972	11,724,541	17,796,513	85.16
(一)店頭市場(OTC)	6,071,972	11,721,165	17,793,137	85.14
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,376	3,376	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	83,002	26,512	109,514	0.53
(一)店頭市場(OTC)	-	6,736	6,736	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	83,002	19,776	102,778	0.49
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	19,598	19,598	0.09
(一)店頭市場(OTC)	-	10,996	10,996	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	8,602	8,602	0.04
小 計(一至四)	8,034,848	12,859,396	20,894,244	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,416	2,416	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	8,034,848	12,861,812	20,896,660	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
114年11月	金 額	8,034,848	12,861,812	20,896,660
	比 重	38.45	61.55	100.00
114年10月	金 額	7,172,422	14,630,020	21,802,442
	比 重	32.90	67.10	100.00
比較增減	差 額	862,426	-1,768,208	-905,782
	變動率	12.02	-12.09	-4.15

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	114年11月		114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)	2,968,619	14.21	2,517,627	11.55	450,992	17.91
(一)店頭市場(OTC)	2,290,004	10.96	1,732,695	7.95	557,309	32.16
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	2,260,988	10.82	1,682,611	7.72	578,377	34.37
3.買入選擇權(Bought Options)	12,422	0.06	15,121	0.07	-2,699	-17.85
4.賣出選擇權(Sold Options)	16,594	0.08	34,963	0.16	-18,369	-52.54
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	678,615	3.25	784,932	3.60	-106,317	-13.54
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	275,508	1.32	392,575	1.80	-117,067	-29.82
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	403,107	1.93	392,357	1.80	10,750	2.74
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)	17,796,513	85.16	19,150,651	87.83	-1,354,138	-7.07
(一)店頭市場(OTC)	17,793,137	85.14	19,146,739	87.82	-1,353,602	-7.07
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,655,377	7.92	1,700,641	7.80	-45,264	-2.66
2.換匯(Fx Swaps)	15,124,790	72.38	16,575,466	76.03	-1,450,676	-8.75
3.換匯換利(Currency Swaps)	39,484	0.19	28,442	0.13	11,042	38.82
4.買入選擇權(Bought Options)	482,976	2.31	411,809	1.89	71,167	17.28
5.賣出選擇權(Sold Options)	490,510	2.34	430,381	1.97	60,129	13.97
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,376	0.02	3,912	0.01	-536	-13.70
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,456	0.01	1,413	0.00	43	3.04
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,920	0.01	2,499	0.01	-579	-23.17
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)	109,514	0.53	104,504	0.48	5,010	4.79
(一)店頭市場(OTC)	6,736	0.04	13,704	0.06	-6,968	-50.85
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	102,778	0.49	90,800	0.42	11,978	13.19
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	19,598	0.09	28,413	0.13	-8,815	-31.02
(一)店頭市場(OTC)	10,996	0.05	12,222	0.06	-1,226	-10.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	8,602	0.04	16,191	0.07	-7,589	-46.87
小 計(一至四)	20,894,244	99.99	21,801,195	99.99	-906,951	-4.16
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	2,416	0.01	1,247	0.01	1,169	93.74
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,416	0.01	1,247	0.01	1,169	93.74
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	20,896,660	100.00	21,802,442	100.00	-905,782	-4.15

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。