

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4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)	623,866	1,301,817	1,925,683	15.45
(一)店頭市場(OTC)	623,866	274,657	898,523	7.21
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,027,160	1,027,160	8.24
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	4,749,102	5,683,763	10,432,865	83.72
(一)店頭市場(OTC)	4,749,102	5,679,630	10,428,732	83.68
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,133	4,133	0.04
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	77,104	12,533	89,637	0.72
(一)店頭市場(OTC)	236	423	659	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	76,868	12,110	88,978	0.71
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	11,380	11,380	0.09
(一)店頭市場(OTC)	-	10,859	10,859	0.09
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	521	521	0.00
小 計(一至四)	5,450,072	7,009,493	12,459,565	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	2,817	2,817	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,450,072	7,012,310	12,462,382	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4月	金 額	5,450,072	7,012,310	12,462,382
	比 重	43.73	56.27	100.00
111年3月	金 額	7,052,821	9,322,678	16,375,499
	比 重	43.07	56.93	100.00
比較增減	差 額	-1,602,749	-2,310,368	-3,913,117
	變動率	-22.72	-24.78	-23.90

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4月		111年3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)	1,925,683	15.45	3,371,516	20.59	-1,445,833	-42.88
(一)店頭市場(OTC)	898,523	7.21	1,481,693	9.05	-583,170	-39.36
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	812,079	6.52	1,404,902	8.58	-592,823	-42.20
3.買入選擇權(Bought Options)	41,573	0.33	33,949	0.21	7,624	22.46
4.賣出選擇權(Sold Options)	44,871	0.36	42,842	0.26	2,029	4.74
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,027,160	8.24	1,889,823	11.54	-862,663	-45.65
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	519,767	4.17	962,992	5.88	-443,225	-46.03
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	507,393	4.07	926,831	5.66	-419,438	-45.26
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)	10,432,865	83.72	12,841,502	78.42	-2,408,637	-18.76
(一)店頭市場(OTC)	10,428,732	83.68	12,836,871	78.39	-2,408,139	-18.76
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,166,368	9.36	1,530,620	9.35	-364,252	-23.80
2.換匯(Fx Swaps)	8,757,848	70.28	10,647,807	65.02	-1,889,959	-17.75
3.換匯換利(Currency Swaps)	19,046	0.15	34,574	0.21	-15,528	-44.91
4.買入選擇權(Bought Options)	243,369	1.95	311,533	1.90	-68,164	-21.88
5.賣出選擇權(Sold Options)	242,101	1.94	312,337	1.91	-70,236	-22.49
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,133	0.04	4,631	0.03	-498	-10.75
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,007	0.02	2,498	0.02	-491	-19.66
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,126	0.02	2,133	0.01	-7	-0.33
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)	89,637	0.72	144,885	0.88	-55,248	-38.13
(一)店頭市場(OTC)	659	0.01	661	0.00	-2	-0.30
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	88,978	0.71	144,224	0.88	-55,246	-38.31
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	11,380	0.09	10,679	0.07	701	6.56
(一)店頭市場(OTC)	10,859	0.09	9,496	0.06	1,363	14.35
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	521	0.00	1,183	0.01	-662	-55.96
小 計(一至四)	12,459,565	99.98	16,368,582	99.96	-3,909,017	-23.88
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,817	0.02	6,917	0.04	-4,100	-59.27
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,817	0.02	6,917	0.04	-4,100	-59.27
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	12,462,382	100.00	16,375,499	100.00	-3,913,117	-23.90

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。