

# 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5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
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	<b>416,591</b>	<b>933,303</b>	<b>1,349,894</b>	<b>10.63</b>
(一)店頭市場(OTC)	416,591	117,082	533,673	4.20
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	816,221	816,221	6.43
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	<b>5,394,395</b>	<b>5,852,131</b>	<b>11,246,526</b>	<b>88.54</b>
(一)店頭市場(OTC)	5,394,395	5,848,787	11,243,182	88.52
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,344	3,344	0.02
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	<b>76,726</b>	<b>15,793</b>	<b>92,519</b>	<b>0.73</b>
(一)店頭市場(OTC)	88	389	477	0.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	76,638	15,404	92,042	0.73
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>10,586</b>	<b>10,586</b>	<b>0.08</b>
(一)店頭市場(OTC)	-	8,487	8,487	0.07
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,099	2,099	0.01
<b>小 計(一至四)</b>	<b>5,887,712</b>	<b>6,811,813</b>	<b>12,699,525</b>	<b>99.98</b>
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>2,492</b>	<b>2,492</b>	<b>0.02</b>
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>總 計</b>	<b>5,887,712</b>	<b>6,814,305</b>	<b>12,702,017</b>	<b>100.00</b>

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5月	金 額	5,887,712	6,814,305	12,702,017
	比 重	46.35	53.65	100.00
111年4月	金 額	5,450,072	7,012,310	12,462,382
	比 重	43.73	56.27	100.00
比較增減	差 額	437,640	-198,005	239,635
	變動率	8.03	-2.82	1.92

附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣

商品種類	111年5月		111年4月		比較增
	合計	比重	合計	比重	差額
<b>一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)</b>	<b>1,349,894</b>	<b>10.63</b>	<b>1,925,683</b>	<b>15.45</b>	<b>-575,789</b>
(一)店頭市場(OTC)	533,673	4.20	898,523	7.21	-364,850
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	509,634	4.01	812,079	6.52	-302,445
3.買入選擇權(Bought Options)	10,622	0.08	41,573	0.33	-30,951
4.賣出選擇權(Sold Options)	13,417	0.11	44,871	0.36	-31,454
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	816,221	6.43	1,027,160	8.24	-210,939
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	415,216	3.27	519,767	4.17	-104,551
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	401,005	3.16	507,393	4.07	-106,388
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-
<b>二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)</b>	<b>11,246,526</b>	<b>88.54</b>	<b>10,432,865</b>	<b>83.72</b>	<b>813,661</b>
(一)店頭市場(OTC)	11,243,182	88.52	10,428,732	83.68	814,450
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,221,104	9.61	1,166,368	9.36	54,736
2.換匯(Fx Swaps)	9,463,597	74.51	8,757,848	70.28	705,749
3.換匯換利(Currency Swaps)	33,039	0.26	19,046	0.15	13,993
4.買入選擇權(Bought Options)	261,692	2.06	243,369	1.95	18,323
5.賣出選擇權(Sold Options)	263,750	2.08	242,101	1.94	21,649
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,344	0.02	4,133	0.04	-789
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,710	0.01	2,007	0.02	-297
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,634	0.01	2,126	0.02	-492
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-
<b>三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)</b>	<b>92,519</b>	<b>0.73</b>	<b>89,637</b>	<b>0.72</b>	<b>2,882</b>
(一)店頭市場(OTC)	477	0.00	659	0.01	-182
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	92,042	0.73	88,978	0.71	3,064
<b>四、商品有關契約(Commodity Contracts)</b>	<b>10,586</b>	<b>0.08</b>	<b>11,380</b>	<b>0.09</b>	<b>-794</b>
(一)店頭市場(OTC)	8,487	0.07	10,859	0.09	-2,372
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,099	0.01	521	0.00	1,578
<b>小計(一至四)</b>	<b>12,699,525</b>	<b>99.98</b>	<b>12,459,565</b>	<b>99.98</b>	<b>239,960</b>
<b>五、信用有關契約(Credit Contracts)</b>	<b>2,492</b>	<b>0.02</b>	<b>2,817</b>	<b>0.02</b>	<b>-325</b>
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	2,492	0.02	2,817	0.02	-325
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)	-	-	-	-	-
<b>六、其他有關契約(Other Contracts)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
1.遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-
2.交換(Swaps)	-	-	-	-	-
3.選擇權(Options)	-	-	-	-	-
<b>總計</b>	<b>12,702,017</b>	<b>100.00</b>	<b>12,462,382</b>	<b>100.00</b>	<b>239,635</b>

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。

