

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)	262,816	874,235	1,137,051	7.91
(一)店頭市場(OTC)	262,816	200,954	463,770	3.23
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	673,281	673,281	4.68
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,553,869	7,595,715	13,149,584	91.42
(一)店頭市場(OTC)	5,553,869	7,593,297	13,147,166	91.40
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,418	2,418	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	64,996	19,503	84,499	0.59
(一)店頭市場(OTC)	-	3,341	3,341	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	64,996	16,162	81,158	0.57
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	11,759	11,759	0.08
(一)店頭市場(OTC)	-	4,923	4,923	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	6,836	6,836	0.05
小 計(一至四)	5,881,681	8,501,212	14,382,893	100.00
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	215	215	0.00
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,881,681	8,501,427	14,383,108	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4月	金 額	5,881,681	8,501,427	14,383,108
	比 重	40.89	59.11	100.00
112年3月	金 額	8,630,605	12,173,355	20,803,960
	比 重	41.49	58.51	100.00
比較增減	差 額	-2,748,924	-3,671,928	-6,420,852
	變動率	-31.85	-30.16	-30.86

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4月		112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)	1,137,051	7.91	2,892,989	13.91	-1,755,938	-60.70
(一)店頭市場(OTC)	463,770	3.23	1,193,431	5.74	-729,661	-61.14
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	442,602	3.08	1,153,572	5.55	-710,970	-61.63
3.買入選擇權(Bought Options)	10,002	0.07	12,313	0.06	-2,311	-18.77
4.賣出選擇權(Sold Options)	11,166	0.08	27,546	0.13	-16,380	-59.46
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	673,281	4.68	1,699,558	8.17	-1,026,277	-60.38
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	333,601	2.32	851,426	4.09	-517,825	-60.82
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	339,680	2.36	848,132	4.08	-508,452	-59.95
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)	13,149,584	91.42	17,748,789	85.31	-4,599,205	-25.91
(一)店頭市場(OTC)	13,147,166	91.40	17,746,147	85.30	-4,598,981	-25.92
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,794,441	12.48	2,225,359	10.69	-430,918	-19.36
2.換匯(Fx Swaps)	10,838,373	75.35	14,681,337	70.57	-3,842,964	-26.18
3.換匯換利(Currency Swaps)	21,816	0.15	54,328	0.26	-32,512	-59.84
4.買入選擇權(Bought Options)	245,818	1.71	392,659	1.89	-146,841	-37.40
5.賣出選擇權(Sold Options)	246,718	1.71	392,464	1.89	-145,746	-37.14
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,418	0.02	2,642	0.01	-224	-8.48
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,270	0.01	1,258	0.00	12	0.95
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,148	0.01	1,384	0.01	-236	-17.05
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)	84,499	0.59	147,920	0.71	-63,421	-42.88
(一)店頭市場(OTC)	3,341	0.02	4,855	0.02	-1,514	-31.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	81,158	0.57	143,065	0.69	-61,907	-43.27
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	11,759	0.08	13,044	0.06	-1,285	-9.85
(一)店頭市場(OTC)	4,923	0.03	5,045	0.02	-122	-2.42
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	6,836	0.05	7,999	0.04	-1,163	-14.54
小 計(一至四)	14,382,893	100.00	20,802,742	99.99	-6,419,849	-30.86
五、信用有關契約(Credit Contracts)	215	0.00	1,218	0.01	-1,003	-82.35
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	215	0.00	1,218	0.01	-1,003	-82.35
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	14,383,108	100.00	20,803,960	100.00	-6,420,852	-30.86

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。