

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
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	618,192	1,219,648	1,837,840	10.24
(一)店頭市場(OTC)	618,192	243,341	861,533	4.80
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	976,307	976,307	5.44
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,479,676	9,486,244	15,965,920	88.99
(一)店頭市場(OTC)	6,479,676	9,483,754	15,963,430	88.97
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	2,490	2,490	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	94,818	30,625	125,443	0.70
(一)店頭市場(OTC)	-	4,514	4,514	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	94,818	26,111	120,929	0.67
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	11,167	11,167	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	3,977	3,977	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	7,190	7,190	0.04
小 計(一至四)	7,192,686	10,747,684	17,940,370	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,538	1,538	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,192,686	10,749,222	17,941,908	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5月	金 額	7,192,686	10,749,222	17,941,908
	比 重	40.09	59.91	100.00
112年4月	金 額	5,881,681	8,501,427	14,383,108
	比 重	40.89	59.11	100.00
比較增減	差 額	1,311,005	2,247,795	3,558,800
	變動率	22.29	26.44	24.74

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5月		112年4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)	1,837,840	10.24	1,137,051	7.91	700,789	61.63
(一)店頭市場(OTC)	861,533	4.80	463,770	3.23	397,763	85.77
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	828,932	4.62	442,602	3.08	386,330	87.29
3.買入選擇權(Bought Options)	13,714	0.08	10,002	0.07	3,712	37.11
4.賣出選擇權(Sold Options)	18,887	0.10	11,166	0.08	7,721	69.15
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	976,307	5.44	673,281	4.68	303,026	45.01
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	509,303	2.84	333,601	2.32	175,702	52.67
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	467,004	2.60	339,680	2.36	127,324	37.48
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)	15,965,920	88.99	13,149,584	91.42	2,816,336	21.42
(一)店頭市場(OTC)	15,963,430	88.97	13,147,166	91.40	2,816,264	21.42
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,886,590	10.51	1,794,441	12.48	92,149	5.14
2.換匯(Fx Swaps)	13,413,073	74.76	10,838,373	75.35	2,574,700	23.76
3.換匯換利(Currency Swaps)	29,517	0.17	21,816	0.15	7,701	35.30
4.買入選擇權(Bought Options)	313,078	1.74	245,818	1.71	67,260	27.36
5.賣出選擇權(Sold Options)	321,172	1.79	246,718	1.71	74,454	30.18
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	2,490	0.02	2,418	0.02	72	2.98
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,233	0.01	1,270	0.01	-37	-2.91
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,257	0.01	1,148	0.01	109	9.49
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)	125,443	0.70	84,499	0.59	40,944	48.46
(一)店頭市場(OTC)	4,514	0.03	3,341	0.02	1,173	35.11
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	120,929	0.67	81,158	0.57	39,771	49.00
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	11,167	0.06	11,759	0.08	-592	-5.03
(一)店頭市場(OTC)	3,977	0.02	4,923	0.03	-946	-19.22
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	7,190	0.04	6,836	0.05	354	5.18
小計(一至四)	17,940,370	99.99	14,382,893	100.00	3,557,477	24.73
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,538	0.01	215	0.00	1,323	615.35
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,538	0.01	215	0.00	1,323	615.35
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	17,941,908	100.00	14,383,108	100.00	3,558,800	24.74

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。