

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表 商 品 種 類 別

113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)	905,695	1,838,355	2,744,050	13.06
(一)店頭市場(OTC)	905,695	329,379	1,235,074	5.88
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,508,976	1,508,976	7.18
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,776,310	11,385,264	18,161,574	86.43
(一)店頭市場(OTC)	6,776,310	11,383,458	18,159,768	86.42
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,806	1,806	0.01
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	72,947	21,862	94,809	0.45
(一)店頭市場(OTC)	-	5,105	5,105	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	72,947	16,757	89,704	0.43
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	9,768	9,768	0.05
(一)店頭市場(OTC)	-	4,656	4,656	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	5,112	5,112	0.03
小 計(一至四)	7,754,952	13,255,249	21,010,201	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,302	1,302	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,754,952	13,256,551	21,011,503	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
113年4月	金 額	7,754,952	13,256,551	21,011,503
	比 重	36.91	63.09	100.00
113年3月	金 額	8,621,290	12,731,304	21,352,594
	比 重	40.38	59.62	100.00
比較增減	差 額	-866,338	525,247	-341,091
	變動率	-10.05	4.13	-1.60

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	113年4月		113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)	2,744,050	13.06	2,612,395	12.23	131,655	5.04
(一)店頭市場(OTC)	1,235,074	5.88	1,562,826	7.32	-327,752	-20.97
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,212,849	5.77	1,537,420	7.20	-324,571	-21.11
3.買入選擇權(Bought Options)	11,443	0.06	13,263	0.06	-1,820	-13.72
4.賣出選擇權(Sold Options)	10,782	0.05	12,143	0.06	-1,361	-11.21
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,508,976	7.18	1,049,569	4.91	459,407	43.77
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	754,310	3.59	468,818	2.19	285,492	60.90
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	754,666	3.59	580,751	2.72	173,915	29.95
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)	18,161,574	86.43	18,628,228	87.24	-466,654	-2.51
(一)店頭市場(OTC)	18,159,768	86.42	18,624,382	87.22	-464,614	-2.49
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,660,973	7.90	2,361,006	11.05	-700,033	-29.65
2.換匯(Fx Swaps)	15,700,352	74.72	15,367,551	71.97	332,801	2.17
3.換匯換利(Currency Swaps)	51,511	0.25	50,878	0.24	633	1.24
4.買入選擇權(Bought Options)	364,550	1.73	413,694	1.94	-49,144	-11.88
5.賣出選擇權(Sold Options)	382,382	1.82	431,253	2.02	-48,871	-11.33
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,806	0.01	3,846	0.02	-2,040	-53.04
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	709	0.00	2,177	0.01	-1,468	-67.43
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,097	0.01	1,669	0.01	-572	-34.27
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)	94,809	0.45	102,263	0.48	-7,454	-7.29
(一)店頭市場(OTC)	5,105	0.02	8,843	0.04	-3,738	-42.27
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	89,704	0.43	93,420	0.44	-3,716	-3.98
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	9,768	0.05	8,058	0.04	1,710	21.22
(一)店頭市場(OTC)	4,656	0.02	2,874	0.01	1,782	62.00
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,112	0.03	5,184	0.03	-72	-1.39
小 計(一至四)	21,010,201	99.99	21,350,944	99.99	-340,743	-1.60
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,302	0.01	1,650	0.01	-348	-21.09
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,302	0.01	1,650	0.01	-348	-21.09
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	21,011,503	100.00	21,352,594	100.00	-341,091	-1.60

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。