

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)	793,824	1,495,328	2,289,152	10.62
(一)店頭市場(OTC)	793,824	175,519	969,343	4.50
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,319,809	1,319,809	6.12
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,350,225	12,804,501	19,154,726	88.85
(一)店頭市場(OTC)	6,350,225	12,800,763	19,150,988	88.83
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,738	3,738	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	72,931	26,710	99,641	0.46
(一)店頭市場(OTC)	-	6,031	6,031	0.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	72,931	20,679	93,610	0.43
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	13,833	13,833	0.06
(一)店頭市場(OTC)	-	8,358	8,358	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	5,475	5,475	0.02
小 計(一至四)	7,216,980	14,340,372	21,557,352	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	7,216,980	14,341,910	21,558,890	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5月	金 額	7,216,980	14,341,910	21,558,890
	比 重	33.48	66.52	100.00
113年4月	金 額	7,754,952	13,256,551	21,011,503
	比 重	36.91	63.09	100.00
比較增減	差 額	-537,972	1,085,359	547,387
	變動率	-6.94	8.19	2.61

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5月		113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)	2,289,152	10.62	2,744,050	13.06	-454,898	-16.58
(一)店頭市場(OTC)	969,343	4.50	1,235,074	5.88	-265,731	-21.52
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	937,128	4.35	1,212,849	5.77	-275,721	-22.73
3.買入選擇權(Bought Options)	13,615	0.06	11,443	0.06	2,172	18.98
4.賣出選擇權(Sold Options)	18,600	0.09	10,782	0.05	7,818	72.51
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,319,809	6.12	1,508,976	7.18	-189,167	-12.54
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	671,413	3.11	754,310	3.59	-82,897	-10.99
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	648,396	3.01	754,666	3.59	-106,270	-14.08
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)	19,154,726	88.85	18,161,574	86.43	993,152	5.47
(一)店頭市場(OTC)	19,150,988	88.83	18,159,768	86.42	991,220	5.46
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,882,493	8.73	1,660,973	7.90	221,520	13.34
2.換匯(Fx Swaps)	16,214,236	75.21	15,700,352	74.72	513,884	3.27
3.換匯換利(Currency Swaps)	36,709	0.17	51,511	0.25	-14,802	-28.74
4.買入選擇權(Bought Options)	500,731	2.32	364,550	1.73	136,181	37.36
5.賣出選擇權(Sold Options)	516,819	2.40	382,382	1.82	134,437	35.16
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,738	0.02	1,806	0.01	1,932	106.98
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,372	0.01	709	0.00	663	93.51
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,366	0.01	1,097	0.01	1,269	115.68
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)	99,641	0.46	94,809	0.45	4,832	5.10
(一)店頭市場(OTC)	6,031	0.03	5,105	0.02	926	18.14
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	93,610	0.43	89,704	0.43	3,906	4.35
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	13,833	0.06	9,768	0.05	4,065	41.62
(一)店頭市場(OTC)	8,358	0.04	4,656	0.02	3,702	79.51
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,475	0.02	5,112	0.03	363	7.10
小 計(一至四)	21,557,352	99.99	21,010,201	99.99	547,151	2.60
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,538	0.01	1,302	0.01	236	18.13
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,538	0.01	1,302	0.01	236	18.13
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	21,558,890	100.00	21,011,503	100.00	547,387	2.61

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。