

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

114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)	1,378,889	1,862,232	3,241,121	14.54
(一)店頭市場(OTC)	1,378,889	398,410	1,777,299	7.97
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	1,463,822	1,463,822	6.57
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	6,401,941	12,531,351	18,933,292	84.96
(一)店頭市場(OTC)	6,401,941	12,523,200	18,925,141	84.92
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	8,151	8,151	0.04
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	63,592	31,198	94,790	0.43
(一)店頭市場(OTC)	10	1,480	1,490	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	63,582	29,718	93,300	0.42
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	12,416	12,416	0.05
(一)店頭市場(OTC)	-	9,161	9,161	0.04
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	3,255	3,255	0.01
小 計(一至四)	7,844,422	14,437,197	22,281,619	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,200	1,410	3,610	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	7,846,622	14,438,607	22,285,229	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
114年4月	金 額	7,846,622	14,438,607	22,285,229
	比 重	35.21	64.79	100.00
114年3月	金 額	8,913,207	16,179,267	25,092,474
	比 重	35.52	64.48	100.00
比較增減	差 額	-1,066,585	-1,740,660	-2,807,245
	變動率	-11.97	-10.76	-11.19

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	114年4月		114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)	3,241,121	14.54	3,172,253	12.64	68,868	2.17
(一)店頭市場(OTC)	1,777,299	7.97	2,089,081	8.32	-311,782	-14.92
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,735,817	7.79	2,051,923	8.17	-316,106	-15.41
3.買入選擇權(Bought Options)	18,191	0.08	11,986	0.05	6,205	51.77
4.賣出選擇權(Sold Options)	23,291	0.10	25,172	0.10	-1,881	-7.47
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	1,463,822	6.57	1,083,172	4.32	380,650	35.14
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	837,703	3.76	529,344	2.11	308,359	58.25
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	626,119	2.81	553,828	2.21	72,291	13.05
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)	18,933,292	84.96	21,797,012	86.87	-2,863,720	-13.14
(一)店頭市場(OTC)	18,925,141	84.92	21,795,573	86.86	-2,870,432	-13.17
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,897,594	8.51	1,541,872	6.14	355,722	23.07
2.換匯(Fx Swaps)	16,302,884	73.16	19,288,244	76.87	-2,985,360	-15.48
3.換匯換利(Currency Swaps)	90,730	0.41	96,469	0.38	-5,739	-5.95
4.買入選擇權(Bought Options)	315,137	1.41	428,243	1.71	-113,106	-26.41
5.賣出選擇權(Sold Options)	318,796	1.43	440,745	1.76	-121,949	-27.67
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	8,151	0.04	1,439	0.01	6,712	466.44
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	4,520	0.02	679	0.00	3,841	565.68
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	3,631	0.02	760	0.01	2,871	377.76
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)	94,790	0.43	110,336	0.44	-15,546	-14.09
(一)店頭市場(OTC)	1,490	0.01	4,415	0.02	-2,925	-66.25
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	93,300	0.42	105,921	0.42	-12,621	-11.92
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	12,416	0.05	11,161	0.04	1,255	11.24
(一)店頭市場(OTC)	9,161	0.04	8,441	0.03	720	8.53
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	3,255	0.01	2,720	0.01	535	19.67
小 計(一至四)	22,281,619	99.98	25,090,762	99.99	-2,809,143	-11.20
五、信用有關契約(Credit Contracts)	3,610	0.02	1,712	0.01	1,898	110.86
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,410	0.01	1,712	0.01	-302	-17.64
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)	2,200	0.01	-	-	2,200	-
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	22,285,229	100.00	25,092,474	100.00	-2,807,245	-11.19

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。