

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)	1,131,690	1,002,401	2,134,091	10.85
(一)店頭市場(OTC)	1,131,690	204,984	1,336,674	6.80
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	797,417	797,417	4.05
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	5,612,349	11,829,167	17,441,516	88.66
(一)店頭市場(OTC)	5,612,349	11,824,340	17,436,689	88.63
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	4,827	4,827	0.03
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	56,649	22,148	78,797	0.40
(一)店頭市場(OTC)	-	4,061	4,061	0.02
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	56,649	18,087	74,736	0.38
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	16,602	16,602	0.08
(一)店頭市場(OTC)	-	10,809	10,809	0.05
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	5,793	5,793	0.03
小 計(一至四)	6,800,688	12,870,318	19,671,006	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,534	150	2,684	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	6,803,222	12,870,468	19,673,690	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5月	金 額	6,803,222	12,870,468	19,673,690
	比 重	34.58	65.42	100.00
114年4月	金 額	7,846,622	14,438,607	22,285,229
	比 重	35.21	64.79	100.00
比較增減	差 額	-1,043,400	-1,568,139	-2,611,539
	變動率	-13.30	-10.86	-11.72

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5月		114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)	2,134,091	10.85	3,241,121	14.54	-1,107,030	-34.16
(一)店頭市場(OTC)	1,336,674	6.80	1,777,299	7.97	-440,625	-24.79
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	1,310,416	6.66	1,735,817	7.79	-425,401	-24.51
3.買入選擇權(Bought Options)	13,624	0.07	18,191	0.08	-4,567	-25.11
4.賣出選擇權(Sold Options)	12,634	0.07	23,291	0.10	-10,657	-45.76
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	797,417	4.05	1,463,822	6.57	-666,405	-45.53
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	410,090	2.08	837,703	3.76	-427,613	-51.05
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	387,327	1.97	626,119	2.81	-238,792	-38.14
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)	17,441,516	88.66	18,933,292	84.96	-1,491,776	-7.88
(一)店頭市場(OTC)	17,436,689	88.63	18,925,141	84.92	-1,488,452	-7.86
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,904,413	9.68	1,897,594	8.51	6,819	0.36
2.換匯(Fx Swaps)	14,835,444	75.41	16,302,884	73.16	-1,467,440	-9.00
3.換匯換利(Currency Swaps)	41,975	0.21	90,730	0.41	-48,755	-53.74
4.買入選擇權(Bought Options)	322,506	1.64	315,137	1.41	7,369	2.34
5.賣出選擇權(Sold Options)	332,351	1.69	318,796	1.43	13,555	4.25
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	4,827	0.03	8,151	0.04	-3,324	-40.78
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,726	0.02	4,520	0.02	-1,794	-39.69
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	2,101	0.01	3,631	0.02	-1,530	-42.14
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)	78,797	0.40	94,790	0.43	-15,993	-16.87
(一)店頭市場(OTC)	4,061	0.02	1,490	0.01	2,571	172.55
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	74,736	0.38	93,300	0.42	-18,564	-19.90
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	16,602	0.08	12,416	0.05	4,186	33.71
(一)店頭市場(OTC)	10,809	0.05	9,161	0.04	1,648	17.99
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	5,793	0.03	3,255	0.01	2,538	77.97
小 計(一至四)	19,671,006	99.99	22,281,619	99.98	-2,610,613	-11.72
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,684	0.01	3,610	0.02	-926	-25.65
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	150	0.00	1,410	0.01	-1,260	-89.36
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)	2,534	0.01	2,200	0.01	334	15.18
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	19,673,690	100.00	22,285,229	100.00	-2,611,539	-11.72

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。