

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商品種類別

115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)	2,227,734	1,221,344	3,449,078	15.42
(一)店頭市場(OTC)	2,227,734	434,260	2,661,994	11.90
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	787,084	787,084	3.52
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Contracts)	7,890,067	10,818,536	18,708,603	83.62
(一)店頭市場(OTC)	7,890,067	10,814,773	18,704,840	83.60
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	3,763	3,763	0.02
三、權益證券有關契約(Equity-Linked Contracts)	144,767	47,722	192,489	0.86
(一)店頭市場(OTC)	122	16,199	16,321	0.07
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	144,645	31,523	176,168	0.79
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	20,361	20,361	0.09
(一)店頭市場(OTC)	-	12,176	12,176	0.05
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	8,185	8,185	0.04
小計(一至四)	10,262,568	12,107,963	22,370,531	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	2,017	1,266	3,283	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總計	10,264,585	12,109,229	22,373,814	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
115年4月	金額	10,264,585	12,109,229	22,373,814
	比重	45.88	54.12	100.00
115年3月	金額	12,974,958	14,606,358	27,581,316
	比重	47.04	52.96	100.00
比較增減	差額	-2,710,373	-2,497,129	-5,207,502
	變動率	-20.89	-17.10	-18.88

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	115年4月		115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)	3,449,078	15.42	7,093,353	25.72	-3,644,275	-51.38
(一)店頭市場(OTC)	2,661,994	11.90	5,693,702	20.64	-3,031,708	-53.25
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	2,500,924	11.18	5,581,667	20.24	-3,080,743	-55.19
3.買入選擇權(Bought Options)	75,661	0.34	62,490	0.22	13,171	21.08
4.賣出選擇權(Sold Options)	85,409	0.38	49,545	0.18	35,864	72.39
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	787,084	3.52	1,399,651	5.08	-612,567	-43.77
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	431,135	1.93	681,441	2.47	-250,306	-36.73
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	355,949	1.59	718,210	2.61	-362,261	-50.44
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 Contracts)	18,708,603	83.62	20,181,593	73.17	-1,472,990	-7.30
(一)店頭市場(OTC)	18,704,840	83.60	20,175,782	73.15	-1,470,942	-7.29
1.遠期契約(Outright Forwards)	982,924	4.39	1,274,327	4.62	-291,403	-22.87
2.換匯(FX Swaps)	16,644,233	74.39	17,506,367	63.47	-862,134	-4.92
3.換匯換利(Currency Swaps)	75,790	0.34	121,708	0.44	-45,918	-37.73
4.買入選擇權(Bought Options)	497,693	2.23	629,425	2.28	-131,732	-20.93
5.賣出選擇權(Sold Options)	504,200	2.25	643,955	2.34	-139,755	-21.70
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	3,763	0.02	5,811	0.02	-2,048	-35.24
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	1,826	0.01	2,521	0.01	-695	-27.57
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	1,937	0.01	3,290	0.01	-1,353	-41.12
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)	192,489	0.86	283,927	1.03	-91,438	-32.20
(一)店頭市場(OTC)	16,321	0.07	7,888	0.03	8,433	106.91
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	176,168	0.79	276,039	1.00	-99,871	-36.18
四、商品有關契約 (Commodity Contracts)	20,361	0.09	20,204	0.07	157	0.78
(一)店頭市場(OTC)	12,176	0.05	17,737	0.06	-5,561	-31.35
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	8,185	0.04	2,467	0.01	5,718	231.78
小計(一至四)	22,370,531	99.99	27,579,077	99.99	-5,208,546	-18.89
五、信用有關契約 (Credit Contracts)	3,283	0.01	2,239	0.01	1,044	46.63
1.信用違約交換(Credit Default Swaps)	1,266	0.00	2,239	0.01	-973	-43.46
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(Others)	2,017	0.01	-	-	2,017	-
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	22,373,814	100.00	27,581,316	100.00	-5,207,502	-18.88

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。