

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)	2,039,232	1,558,302	3,597,534	16.63
(一)店頭市場(OTC)	2,039,232	461,550	2,500,782	11.56
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	1,096,752	1,096,752	5.07
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Contracts)	6,959,749	10,820,811	17,780,560	82.18
(一)店頭市場(OTC)	6,959,749	10,814,580	17,774,329	82.15
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	6,231	6,231	0.03
三、權益證券有關契約(Equity-Linked Contracts)	184,651	48,163	232,814	1.08
(一)店頭市場(OTC)	283	21,527	21,810	0.10
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	184,368	26,636	211,004	0.98
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	-	20,388	20,388	0.09
(一)店頭市場(OTC)	-	11,259	11,259	0.05
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	-	9,129	9,129	0.04
小計(一至四)	9,183,632	12,447,664	21,631,296	99.98
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	4,489	4,489	0.02
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總計	9,183,632	12,452,153	21,635,785	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5月	金額	9,183,632	12,452,153	21,635,785
	比重	42.45	57.55	100.00
115年4月	金額	10,264,585	12,109,229	22,373,814
	比重	45.88	54.12	100.00
比較增減	差額	-1,080,953	342,924	-738,029
	變動率	-10.53	2.83	-3.30

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5月		115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)	3,597,534	16.63	3,449,078	15.42	148,456	4.30
(一)店頭市場(OTC)	2,500,782	11.56	2,661,994	11.90	-161,212	-6.06
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	2,323,041	10.74	2,500,924	11.18	-177,883	-7.11
3.買入選擇權(Bought Options)	129,118	0.60	75,661	0.34	53,457	70.65
4.賣出選擇權(Sold Options)	48,623	0.22	85,409	0.38	-36,786	-43.07
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	1,096,752	5.07	787,084	3.52	309,668	39.34
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	532,478	2.46	431,135	1.93	101,343	23.51
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	564,274	2.61	355,949	1.59	208,325	58.53
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)	17,780,560	82.18	18,708,603	83.62	-928,043	-4.96
(一)店頭市場(OTC)	17,774,329	82.15	18,704,840	83.60	-930,511	-4.97
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,044,448	4.83	982,924	4.39	61,524	6.26
2.換匯(FX Swaps)	15,657,285	72.37	16,644,233	74.39	-986,948	-5.93
3.換匯換利(Currency Swaps)	53,780	0.25	75,790	0.34	-22,010	-29.04
4.買入選擇權(Bought Options)	502,335	2.32	497,693	2.23	4,642	0.93
5.賣出選擇權(Sold Options)	516,481	2.38	504,200	2.25	12,281	2.44
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	6,231	0.03	3,763	0.02	2,468	65.59
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	2,243	0.01	1,826	0.01	417	22.84
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	3,988	0.02	1,937	0.01	2,051	105.89
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)	232,814	1.08	192,489	0.86	40,325	20.95
(一)店頭市場(OTC)	21,810	0.10	16,321	0.07	5,489	33.63
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	211,004	0.98	176,168	0.79	34,836	19.77
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	20,388	0.09	20,361	0.09	27	0.13
(一)店頭市場(OTC)	11,259	0.05	12,176	0.05	-917	-7.53
(二)交易所(Exchange-Traded Contracts)	9,129	0.04	8,185	0.04	944	11.53
小計(一至四)	21,631,296	99.98	22,370,531	99.99	-739,235	-3.30
五、信用有關契約(Credit Contracts)	4,489	0.02	3,283	0.01	1,206	36.73
1.信用違約交換(Credit Default Swaps)	4,489	0.02	1,266	0.00	3,223	254.58
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	-100.00
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	21,635,785	100.00	22,373,814	100.00	-738,029	-3.30

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。