

衍生性金融商品契約類型申報表

報表編號：AI710

金融機構代號及名稱：

上次更新日期：xxx/xx/xx

項 目	內 容 A
一、商品名稱	
二、開辦日期	
三、銀行報備或經主管機關核准之日期及文號	
四、董事會同意辦理日期	
五、商品屬性及其內容	
(一)交易契約之價值 (payoff) 衍生自 (可複選) 1.利率 2.匯率 3.股價 4.指數 5.商品 9.其他利益	
(二) 商品屬性 (可複選) 1.期貨 2.選擇權 3.交換 4.遠期契約 11.本金連結衍生性金融商品之結構型商品 (structured deposits) 12.組合式債權 (structured debt obligations, 例如組合式投資等, 非屬前項者即屬此類) 9.其他	
(三) 辦理之單位 1.DBU 2.OBU 3.DBU 及 OBU	
(四) 交易對手屬性 (可複選) 1.一般存款大眾 2.特定客戶 (如銀行同業、綜合證券商、證券投資信託公司、人壽保險公司及外國投資金融機構等) 3.其他	
(五) 交易對手所需承擔風險之最大損失 (單選) 1.保本比率 2.其他	
(六) 交易方式 1.非集中市場 2.集中市場	

- 註:
- 如於五 (一)、五 (二)、五 (四) 及五 (五) 選「其他」者, 需說明原因。
 - 於五 (五) 請填保本比率或其他避險方式。

3. 銀行依國際財務報導準則第 9 號公報評估衍生性金融商品之公允價值，應以所能取得最接近當月底之市價評估。

◎ 維護時點及程序表：

維護/申報頻率							維護/申報 時點	維護/申報 程序	維護/申報 項目
事前 維護	事後 維護	即時 維護	次 月 10 日 內	次 季 10 日 內	次 年 5 個 月 內	其 他			
						※	辦理衍生性金融商品 項目及其重要內容 有更新或異動時， 應立即維護。	依「銀行辦理衍生性金 融商品業務內部作業 制度及程序管理辦法」 辦理。	全部項目