

# 衍生性金融商品信用有關契約名目本金交易餘額月報表

民國 年 月 日

報表編號：AI706

金融機構代號及名稱：

單位：美元

項 目  代號		國內總分支機構及國際金融業務分行						海外 分行 C	海外 子銀行 D	合計 T	帳列餘額 合計 E	本期評價 損益 F
		國內總分支機構			國際金融業務分行							
		國內顧客 A1	國內同業 A2	國外 A3	國內顧客 B1	國內同業 B2	國外 B3					
信用有關契約(CREDIT CONTRACTS)												
1100	(一)信用違約交換(CREDIT DEFAULT SWAP)											
1110	1.信用違約買方(PROTECTION BUYER)											
1111	(1)單名商品(SINGLE-NAME INSTRUMENTS)											
1112	(2)複名商品(MULTI-NAME INSTRUMENTS)											
1120	2.信用違約賣方(PROTECTION SELLER)											
1121	(1)單名商品(SINGLE-NAME INSTRUMENTS)											
1122	(2)複名商品(MULTI-NAME INSTRUMENTS)											
1200	(二)買入信用違約選擇權(BOUGHT CREDIT DEFAULT OPTIONS)											
1300	(三)賣出信用違約選擇權(SOLD CREDIT DEFAULT OPTIONS)											
1900	(九)其他(OTHER)											
附表資料											匯率	
9900	月底新臺幣對美元之結帳匯率(即 NTD/USD，請填報至小數後第四位)											

註：帳列餘額合計係指衍生性金融商品信用有關契約經過評價之金融資產或金融負債之帳列餘額。

◎ 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 前	次 季 10 日 前	次 年 5 個 月 內	其 他			
						※	每月業務資料部分，應 於次月 15 日前維護。	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