

# 衍生性金融商品信用有關契約名目本金交易餘額分類月報表

民國      年      月      日

報表編號：AI707

金融機構代號及名稱：

單位：美元

代號	項目	剩餘期限別			合約信用實體別				合約信用實體之信用評等別				交易餘額
		1 年(含) 以下  (A1)	1 年以 上 5 年 以下  (A2)	5 年(不 含)以上  (A3)	主權國 家  (B1)	金融機 構  (B2)	企業  (B3)	其他  (B4)	投資 等級  (C1)	非投資 等級  (C2)	無評等  (C3)	其他  (C4)	合計  (D)
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)												
1990	合計												

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 1：合約信用實體之信用評等屬投資等級者，係指依「商業銀行投資有價證券之種類及限額規定」第四條規定經信用評等機構評定達一定等級以上。

註 2：合約信用實體為複名商品，若同時包含 B1、B2、B3 兩項以上，請填 B4；若投資等級包含 C1、C2、C3 兩項以上，請填 C4；若為指數(index)，請按比例填報。

註 3：本表不含海外子銀行。

◎ 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			
						※	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