

AI701 衍生性金融商品名目本金交易量月報表

民國 年 月 日

報表編號：AI701

金融機構代號及名稱：

單位：美元

交易單位		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	國際金 融業務 分行 E	合計 T (不計入 D 及 E 欄)
交易幣別		涉及新臺幣交易			純外幣交易						
項目代號及名稱		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				
一、利率有關契約(INTEREST RATE CONTRACTS)											
1100	(一)店頭市場(OTC)										
1110	1.遠期利率協議(FRA)										
1120	2.換利(INTEREST RATE SWAPS)										
1130	3.買入選擇權(BOUGHT OPTIONS)										
1140	4.賣出選擇權(SOLD OPTIONS)										
1200	(二)交易所(EXCHANGE-TRADED CONTRACTS)										
1210	1.期貨-長部位(FUTURES-LONG POSITIONS)										

1220	2.期貨-短部位(FUTURES-SHORT POSITIONS)										
1230	3.買入選擇權(BOUGHT OPTIONS)										
1240	4.賣出選擇權(SOLD OPTIONS)										
二、匯率有關契約(FOREIGN EXCHANGE CONTRACTS)											
2100	(一)店頭市場(OTC)										
2110	1.遠期契約(OUTRIGHT FORWARDS)										
2120	2.換匯(FOREIGN EXCHANGE SWAPS)										
2130	3.換匯換利(CURRENCY SWAPS)										
2140	4.買入選擇權(BOUGHT OPTIONS)										
2150	5.賣出選擇權(SOLD OPTIONS)										
2200	(二)交易所(EXCHANGE-TRADED CONTRACTS)										
2210	1.期貨-長部位(FUTURES-LONG POSITIONS)										
2220	2.期貨-短部位(FUTURES-SHORT POSITIONS)										
2230	3.買入選擇權(BOUGHT OPTIONS)										
2240	4.賣出選擇權(SOLD OPTIONS)										
三、權益證券有關契約(EQUITY-LINKED CONTRACTS)											
3100	(一)店頭市場(OTC)										
3200	(二)交易所(EXCHANGE-TRADED CONTRACTS)										
四、商品有關契約(COMMODITY CONTRACTS)											

4100	(一)店頭市場(OTC)										
4200	(二)交易所(EXCHANGE -TRADED CONTRACTS)										
五、信用有關契約(CREDIT CONTRACTS)											
5100	(一)信用違約交換(CREDIT DEFAULT SWAP)										
5110	1.信用違約買方(PROTECTION BUYER)										
5111	(1)單名商品(SINGLE-NAME INSTRUMENTS)										
5112	(2)複名商品(MULTI-NAME INSTRUMENTS)										
5120	2.信用違約賣方(PROTECTION SELLER)										
5121	(1)單名商品(SINGLE-NAME INSTRUMENTS)										
5122	(2)複名商品(MULTI-NAME INSTRUMENTS)										
5200	(二)買入信用違約選擇權(BOUGHT CREDIT DEFAULT OPTIONS)										
5300	(三)賣出信用違約選擇權(SOLD CREDIT DEFAULT OPTIONS)										
5900	(九)其他(OTHER)										
八、其它契約(OTHER CONTRACTS)											
8100	(一)遠期契約(OUTRIGHT FORWARDS)										
8200	(二)交換(SWAPS)										
8300	(三)選擇權(OPTION)										

附表資料（單位：美元）		金額 A
9100	（一）新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易量	
9110	1.國內顧客	
9120	2.國內同業	
9130	3.國外	
9200	（二）外幣保證金交易量	
9210	1.契約別：	
9211	（1）即期契約	
9212	（2）遠期契約	
9220	2.對象別：	
9221	（1）國內顧客	
9222	（2）國外	
9300	（三）人民幣對外幣無本金交割遠期外匯交易量	
9310	1.國內顧客	
9320	2.國內同業	
9330	3.國外	
9400	（四）人民幣對外幣無本金交割匯率選擇權交易量	
9410	1.國內顧客	

9420	2.國內同業	
9430	3.國外	
9500	(五) 海外分行承作新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易量	
9900	(九) 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.本表係填報當月承作衍生性金融商品交易之名目本金累計數。交易之填報時點，係以交易日（即訂約日）為準，嗣後交割不再填報。

2.本表所稱名目本金(NOTIONAL AMOUNTS)係指衍生性金融商品之面額、契約金額或名目本金。若衍生性商品契約有槓桿倍數(MULTIPLIER COMPONENT)者，應填報實質名目本金（即契約名目本金乘以倍數）；單期或多期比價之選擇權交易，應先將交易內容分解為原始型態後，以契約名目本金乘以「槓桿倍數」再乘以「比價交割期數」申報交易量；「比價交割期數」不包括僅比價不交割者。

3.本表係填報本國銀行總分支機構、國際金融業務分行、海外分行及海外子銀行資料。同一銀行總分支機構間之內部交易，若屬國內分支機構（含國內總分支機構與國際金融業務分行）間以背對背（back to back）方式處理、或為內部帳務處理而進行者，均不計入本表交易量統計，反之則計入。

4.本表金額單位為美元。純新臺幣交易請按月底結帳匯率折成美元填報。

5.本表「交易對象」各欄係以交易對象所在地（非所屬國籍）為區分標準，因此「國內同業」係指本國境內營業之本國銀行（包括國內總分支機構及國際金融業務分行）及外國銀行在台分行（包括一般分行及國際金融業務分行），惟不含中央銀行。國內其他類金融機構、中央銀行及顧客請填報於「國內顧客」欄。「國外」欄係指境外之分支機構、銀行同業或顧客。交易所交易依交易所所在地分別填報於國內顧客或國外。

6.「海外子銀行」係指投資海外之金融機構（包括銀行及性質相近之公司），持有被投資金融機構股權超過 50%，或未超過 50%但有經營控制權者。

7.本表係以衍生性金融商品契約隱含之風險為分類標準，分為利率、匯率、權益證券、商品及信用等五類；其中「匯率」不包含黃金，黃金有關契約請填報於「商品有關契約」之欄位。若屬複合型衍生性金融商品，應分辨其所隱含之各類風險，分別填報於其所屬風險之欄位。若該商品隱含之各類風險無法明確區分者，則填報於所隱含主要風險類別之欄位。若對風險分類有疑義時，則適用下列順序填報於該類風險欄位中：(1)信用、(2)商品、(3)權益證券、(4)匯率、(5)利率。若不屬於上述各類請填報於其他有關契約欄。

- 8.混合式金融商品，如主契約及嵌入式衍生性金融商品可分別認列者，應將衍生性金融商品部分之交易有關資料填報於本表。
- 9.「利率有關契約」係填報僅涉及單一幣別之利率契約。所有涉及兩種幣別以上之契約填報於「匯率有關契約」類。
- 10.交換交易(SWAPS)係視為一筆交易填報，不須分別填報換入及換出兩筆金額。換匯交易(FX SWAPS)包括短天期之換匯交易，如當日隔夜(OVERNIGHT)、次日隔夜(TOMORROW/NEXT DAY)之換匯交易。信用違約交換之「單名商品」(SINGLE-NAME INSTRUMENTS)係指約定單一合約信用實體(REFERENCE ENTITY)之信用違約交換契約；「複名商品」(MULTI-NAME INSTRUMENTS)係指約定多個合約信用實體(REFERENCE ENTITY)之信用違約交換契約。
- 11.「買入選擇權」係指銀行支付權利金買入「買權」(Call Option)或「賣權」(Put Option)；「賣出選擇權」係指銀行收取權利金賣出「買權」(Call Option)或「賣權」(Put Option)。
- 12.「八、其它契約」包括氣候、指數及未在一至五類之其他衍生性商品交易。
- 13.「匯率有關-遠期契約」中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者及人民幣對外幣無本金交割遠期外匯交易。
- 14.「匯率有關-買入、賣出選擇權」中「純外幣交易」金額包括人民幣對外幣無本金交割匯率選擇權交易。
- 15.「附表資料」係填報國內總分支機構及國際金融業務分行資料，除「9500 海外分行承作新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易量」外，不包括海外分行及海外子銀行資料。

一、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