

證券化與結構型商品統計表

(二) 辦理結構型商品

民國 年 月底

報表編號: DI272 (季報)

金融機構名稱及代號:

附表 1

單位: 新臺幣千元

商品代碼	商品分類 (依取得資金方式分類)	辦理餘額 -新臺幣 A	辦理餘額 -外幣(折合 新臺幣) B	合計 C=A+B
2100	(一) 結構型商品之本金			
2200	(二) 借款			
2300	(三) 債券			
2400	(四) 票券			
2900	(五) 其他			
2999	合計			

註: 本表不含非由銀行擔任結合者之結構型商品。

報表編號: DI273 (季報)

附表 2

單位: 新臺幣千元

項目代號	結構型商品		衍生性金融商品 (名目本金餘額)					
	幣別	取得資金方式分類	利率 A	匯率 B	權益 證券 C	商品 D	信用 E	其他 F
2101	新 臺 幣	(一) 結構型商品之本金						
2201		(二) 借款						
2301		(三) 債券						
2401		(四) 票券						
2901		(五) 其他						
2102	外 幣	(一) 結構型商品之本金						
2202		(二) 借款						
2302		(三) 債券						
2402		(四) 票券						
2902		(五) 其他						

註: 1. 依銀行辦理結構型商品時取得資金方式分類。

2. 「名目本金餘額」係填列銀行所連結之衍生性金融商品之各類衍生性金融商品契約名目本金餘額之合計數。

經辦人員及聯絡電話:

主管:

一、填報說明：

- (一) 本份報表（包括 DI272、DI273）申報單位為大陸地區銀行在臺分行（含國際金融業務分行）。
- (二) 本份報表金額單位為新臺幣千元。外幣金額按填報基準日結帳匯率折成新臺幣填報。
- (三) 本份報表填報範圍包括銀行承作結構型商品交易。結構型商品，係結合固定收益商品（例如定期存款或債券）或黃金與衍生性金融商品（例如選擇權）的組合型式商品交易。本份報表不包括可轉換公司債、特定金錢信託及投資型保險商品。
- (四) DI272、DI273 辦理結構型商品，指銀行與客戶承作之結構型商品，由銀行擔任商品之結合者，不含非由銀行擔任結合者之結構型商品。
- (五) DI272、DI273 之辦理金額，係按發行及辦理各類商品之面額或契約金額統計。
- (六) DI272 結構型商品依銀行辦理結構型商品時取得資金方式分類。
- (七) DI273 結構型商品依所結合衍生性金融商品隱含之風險為分類標準，若屬複合型衍生性金融商品，應分辨其所隱含之各類風險，分別填報各類衍生性金融商品契約名目本金餘額之合計數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。

二、維護時點及程序表：按季於次月十五日前填報。