

國際證券業務分公司代號：

國際證券業務分公司名稱：

報表日期：

報表編號：

報表名稱：

單一單位：國際證券業務分公司辦理人民幣外匯交易及外幣衍生性金融商品交易量月報表

人民幣千元

| | | |
|-------|---|---|
| 民國 | 年 | 月 |
| S06-2 | | |

| 項目代號 | 商品種類 | 交易對象 | | | | | 合計 | |
|---|-----------------------------------|---------|----------|----------------|---------|--------|--------|--|
| | | 境內專業投資人 | | | 非居住民 | | | |
| | | 外匯指定銀行 | 國際金融業務分行 | 其他證券商國際證券業務分公司 | 其他專業投資人 | 境外金融機構 | 其他非居住民 | |
| 人民幣與外幣間即期外匯交易 | | | | | | | | |
| 一、債券或利率有關契約 (BONDS OR INTEREST RATE CONTRACTS) | | | | | | | | |
| (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) | | | | | | | |
| (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) | | | | | | | | |
| (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) | | | | | | | |
| (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 | 1.信用違約交換(CREDIT DEFAULT SWAP) | | | | | | | |
| 5110 | (1)信用違約買方 | | | | | | | |
| 5120 | (2)信用違約賣方 | | | | | | | |
| 5200 | 2.信用違約選擇權(CREDIT DEFAULT OPTIONS) | | | | | | | |
| 5300 | 3.總報酬交換契約(TOTAL RETURN SWAPS) | | | | | | | |
| 5400 | 4.其他(OTHER) | | | | | | | |
| 六、其他有關契約(OTHER CONTRACTS) | | | | | | | | |
| 6101 | 1.遠期契約(OUTRIGHT FORWARDS) | | | | | | | |
| 6102 | 2.交換(SWAPS) | | | | | | | |
| 6103 | 3.選擇權(OPTIONS) | | | | | | | |
| | 合計： | | | | | | | |

註:

- 1.本表除「人民幣與外幣間即期外匯交易」外，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/債券、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。
- 2.本表之衍生性金融商品交易量係填報當月承做人民幣衍生性金融商品交易之名目本金累計數。交易認列填報時點以交易日（訂約日）為準，嗣後無論有無交割不再填報。
- 3.本表填報之衍生性金融商品限名目本金為人民幣、交割幣別為人民幣或連結標的資產涉及大陸地區者。
- 4.若衍生性金融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）。
- 5.國際證券業務分公司與證券商總公司或其他分支機構間之內部交易，若屬國內分支機構間以背對背（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，反之則應計入。
- 6.複合型衍生性金融商品，應分辨並依其所隱含之各類風險，分別填報於其所屬風險之欄位；若隱含之各類風險無法明確區分，則依主要風險填報於適當欄位。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/債券。若不屬於上述各類請填報於其他有關契約欄，並詳述商品種類。
- 7.組合式金融商品，應將其交易內容分解為原始型態，並將衍生性金融商品部分之交易有關資料填報於本表。嵌入式衍生性金融商品，其會計處理無須與非衍生性金融商品分別認列者則免填報。
- 8.「債券或利率有關契約」係填報僅涉及單一幣別之利率/債券契約；所有涉及兩種幣別以上之契約填報於「匯率有關契約」類。
- 9.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。
- 10.所稱「非居住民」係指境外之個人、法人、政府機關或金融機構，而信用衍生性金融商品之交易對象，限境外專業機構投資人。
- 11.所稱「專業投資人」或「專業機構投資人」應符合境外結構型商品管理規則第三條規定。
- 12.若填報其他有關契約請依序加列並詳述商品種類及金額。
- 13.本報表應於每月10日前上傳證券商申報單一窗口。

主管：

覆核：

製表：

聯絡電話：