

# 證券商辦理外匯業務及衍生性外匯商品交易量月報表

## 年 月 份

報表編號:S701

證券商名稱及代號:

(102年4月3日修訂)

### 一、證券商結購、結售外匯

單位:等值千美元

項目代碼	投資項目	結購外幣/匯出(A)		結售外幣/匯入(B)		淨額(A-B)
		人民幣	非人民幣之外幣	人民幣	非人民幣之外幣	
9993	自行買賣(含承銷取得)外國人發行外幣有價證券					
9994	自行買賣(含承銷取得)本國人發行外幣有價證券					
9995	自行買賣(含承銷取得)外國有價證券					
9996	外幣計價涉及國內股權之衍生性或結構型商品					
9997	涉及非國內股權之衍生性外匯商品或結構型商品					
9998	發行海外或國內認購(售)權證					
9999	其他交易					
	合計:					

備註: 1. 本表應將證券商因從事上述業務, 而於本月份實際結購及結售外匯之金額及其淨額分別填報。

2. 若填報其他交易, 請自行依序加列並詳述商品種類及金額。

### 二、衍生性外匯商品名目本金交易量

單位:等值千美元

項目代號	交易對象 商品種類	證券商國內總分支機構							
		涉及新台幣交易				純外幣交易			
		國內顧客	國內指定銀行	國內證券商	國外	國內顧客	國內指定銀行	國內證券商	國外
		A1	A2-1	A2-2	A3	B1	B-1	B2-2	B3
<b>一、債券或利率有關契約 (BONDS OR INTEREST RATE CONTRACTS)</b>									
	(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)								
<b>二、匯率有關契約(FOREIGN EXCHANGE CONTRACTS)</b>									
	(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)								
<b>三、權益證券有關契約(EQUITY-LINKED CONTRACTS)</b>									
3100	(一)店頭市場(OTC)								
3200	(二)交易所(EXCHANGE-TRADED CONTRACTS)								

<b>四、商品有關契約(COMMODITY CONTRACTS)</b>									
4100	(一)店頭市場(OTC)								
4200	(二)交易所(EXCHANGE -TRADED CONTRACTS)								
<b>五、信用有關契約(CREDIT CONTRACTS)</b>									
5100	1. 信用違約交換(CREDIT DEFAULT SWAP)								
5101	(1)信用違約買方(PROTECTION BUYER)								
511A	(a)單名商品(SINGLE-NAME INSTRUMENTS)								
511B	(b)複名商品(MULTI-NAME INSTRUMENTS)								
5102	(2)信用違約賣方(PROTECTION SELLER)								
512A	(a)單名商品(SINGLE-NAME INSTRUMENTS)								
512B	(b)複名商品(MULTI-NAME INSTRUMENTS)								
5200	2. 買入信用違約選擇權(BOUGHT CREDIT DEFAULT OPTIONS)								
5300	3. 賣出信用違約選擇權(SOLD CREDIT DEFAULT OPTIONS)								
5400	4. 其他(OTHER)								
<b>六、其他有關契約(OTHER CONTRACTS)</b>									
6101	1. 遠期契約(OUTRIGHT FORWARDS)								
6102	2. 交換(SWAPS)								
6103	3. 選擇權(OPTIONS)								

備註：若填報其他有關契約請依序加列並詳述商品種類及金額

### 三、連結國外金融商品、國內股權之結構型商品流通在外名目本金餘額

契約名目本金	新臺幣本金 (新臺幣千元)		非人民幣之外幣本金 (等值千美元)				人民幣本金 (人民幣千元)	
			股權		債券或利率		股權	債券或利率
連結金融商品風險類別	非大陸地區 之外國股權	不含人民幣債 券/利率之外 幣債券/外國 利率(含指標)	非大陸地 區之外國 股權	國內股權	大陸地區 股權(含香 港H股等)	不含人民幣債 券/利率之外 幣債券/外國 利率(含指標)	大陸地區 股權(含香 港H股等)	人民幣債券 /利率(含指 標)
上月底流通在外								
本月新增								
本月到期或提前解約								
本月底流通在外								

### 四、以人民幣計價或涉及大陸地區標的之衍生性外匯商品名目本金交易量

商品種類	計價幣別	人民幣計價 (人民幣千元)		非人民幣之外幣 (等值千美元)
		大陸地區 股權(含香 港H股等)	人民幣債券/ 利率(含指標)	大陸地區股權 (含香港H股等)
<b>一、債券或利率有關契約 (BONDS OR INTEREST RATE CONTRACTS)</b>				
(一)店頭市場(OTC)				
(二)交易所				
<b>二、匯率有關契約(FOREIGN EXCHANGE CONTRACTS)</b>				
(一)店頭市場(OTC)				
(二)交易所				
<b>三、權益證券有關契約(EQUITY-LINKED CONTRACTS)</b>				
(一)店頭市場(OTC)				
(二)交易所				

覆核姓名及電話：

經辦姓名及電話：