

銀行代號：
 報表日期：民國109年12月
 報表編號：FB5
 報表名稱：國際金融業務分行人民幣外匯交易及衍生性金融商品交易明細表
 單位：人民幣千元

109年12月版

項目代號	業務項目	交 易 量								本月合計	本月底 未實現損益
		境 內				境 外					
		他行OBU	OSU	OIU	DBU	DSU	DIU	其他			
100	外匯交易	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
110	即期外匯 (Spot)									0	
120	遠期外匯 (Forward)									0	
130	換匯 (FX Swap)									0	
200	衍生性金融商品	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
210	期貨	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
211	匯率期貨 (Currency Futures)									0	
212	利率期貨 (Interest Rate Futures)									0	
213	商品期貨 (Commodity Futures)									0	
214	股價指數期貨 (Equity Futures)									0	
220	選擇權	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
221	匯率選擇權 (Currency Options)									0	
222	利率選擇權 (Interest Rate Options)									0	
223	商品選擇權 (Commodity Options)									0	
224	股價選擇權 (Equity Options)									0	
225	期貨選擇權 (Futures Options)									0	
230	交換	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
231	利率交換 (Interest Rate Swaps)									0	
232	換匯換利 (Cross Currency Swaps)									0	
233	商品價格交換 (Commodity Swaps)									0	
234	股價交換 (Equity Swaps)									0	
240	遠期契約	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
241	遠期利率協定 (Forward Rate Agreements)									0	
242	商品遠期契約 (Commodity Forwards)									0	
243	股價遠期契約 (Equity Forwards)									0	
250	外幣保證金交易 (Margin Tradings)									0	
260	信用衍生商品 (Credit Contracts)									0	
290	其他									0	

註:

1. 本表資料包含：(1) 避險及非避險交易；(2) 自營交易。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。

2. 本表係填報當月承做衍生性金融商品交易之名目本金。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）。
3. 遠期外匯 (Forward) 包括無本金交割之外幣對人民幣遠期外匯 (NDF)。
4. 匯率選擇權 (Currency Options) 包括無本金交割之外幣對人民幣匯率選擇權 (NDO)。
5. 利率交換 (Interest Rate Swaps) 包括無本金交割之外幣對人民幣利率交換 (NDIRS)。
6. 換匯換利 (Cross Currency Swaps) 包括無本金交割之外幣對人民幣換匯換利 (NDCCS)。
7. 複合型衍生性金融商品，應分辨並依其所隱含之各類風險，分別填報於適當欄位；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。
8. 於集中市場交易之商品項目，依受託下單機構之類別，分別填報。
9. 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。
10. 衍生性金融商品之比價期數大於1，且各期損益獨立計算者，應按註9說明，將其交易內容分解為原始型態後，計算各期（實質）名目本金總合，再將各期總合加總填報為該商品承做量。
11. 「OBU」、「OSU」、「OIU」分別係指國際金融業務分行、國際證券業務分公司、國際保險業務分公司；「DBU」、「DSU」、「DIU」分別係指經中央銀行許可辦理外匯業務之銀行、證券業、保險業。
12. 「境內」\「其他」係指依金管會109年10月26日金管銀控字第10902733851號令，得從事授信目的帳戶相關外匯交易之境內法人。
13. 「未實現損益」係將未結清部位以公允價值評估計列。
14. 與他行OBU如有交易，請另填表 [FB5A-國際金融業務分行與他行OBU人民幣外匯交易及衍生性金融商品交易明細表]。
15. 灰色網底表無此項目或依現行法規應無數值；黃色網底儲存格數值自動運算，不需填列。