

附件五

○○證券股份有限公司
櫃檯買賣債券遠期交易營業日報表

印表日期： / /
頁 次： /
單 位：元，%

(賣出) 證券商編號

成交日期： / /

自營 經紀	帳 號 (客戶名稱)	債券名稱	成交面額	殖利率 (成交價)	交割日	成交金額	應計利息	交易稅	應收/付金額
					/ /				收 付
小計					/ /				
小計					/ /				

合計：

製表：

覆核：

會計：

主管：

(以交割日為小計)

○○證券股份有限公司
櫃檯買賣債券遠期交易營業日報表

印表日期： / /
頁 次： /
單 位：元，%

(買進) 證券商編號

成交日期： / /

自營 經紀	帳 號 (客戶名稱)	債券名稱	成交面額	殖利率 (成交價)	交割日	成交金額	應計利息	交易稅	應收/付金額
					/ /				收 付
小計					/ /				
					/ /				
小計					/ /				

合計：

製表：

覆核：

會計：

主管：

○○證券股份有限公司
○年○月 櫃檯買賣債券遠期交易營業月報表

印表日期： / /
頁 次： /
單 位：元

(買進) 證券商編號

自營 經紀	債券名稱	成交面額	總筆數	交割日	總成交金額	應計利息	交易稅	應收/付金額
				/ /				收 付
小計				/ /				
				/ /				
小計				/ /				
合計：								

製表：

覆核：

會計：

主管：

(總筆數：以交割日統計)

○○證券股份有限公司
○年○月 櫃檯買賣債券遠期交易營業月報表

印表日期： / /
頁 次： /
單 位：元

(賣出) 證券商編號

自營 經紀	債券名稱	成交面額	總筆數	交割日	總成交金額	應計利息	交易稅	應收/付金額
				/ /				收 付
小計				/ /				
				/ /				
小計				/ /				
合計：								

製表：

覆核：

會計：

主管：

○○證券股份有限公司
櫃檯買賣債券未到期交易餘額統計表（日報）

印表日期： / /
頁 次： /
單 位：元

證券商編號

	買 進 餘 額	賣 出 餘 額
附買回交易		
附賣回交易		
營業處所 發行前交易		
遠期交易 減：同日交割部位		
合 計		

【註：不含債券等殖成交系統之發行前交易】

（提供金額，不是面額）

製表：

覆核：

會計：

主管：

○○證券股份有限公司
櫃檯買賣債券未到期交易餘額統計表（月報）

印表日期： / /
頁 次： /
單 位：元

證券商編號

	買 進 餘 額	賣 出 餘 額
附買回交易		
附賣回交易		
營業處所 發行前交易		
遠期交易 減：同日交割部位		
合 計		

【註：不含債券等殖成交系統之發行前交易】

製表：

覆核：

會計：

主管：

○○○○○○公司債券遠期買賣未到期交易明細表（日報）

資料期間：

年 月 日

共 頁，頁次： 之

單位：新台幣元

債券代號	買賣別	成交日	交割日	交易對象	成交面額	成交殖利率	成交金額 (除息金額)	應計利息	應收付金額
小 計									
小 計									
合 計									

經辦：

業務主管：

○○○○○○○公司債券遠期買賣未到期交易明細表（月報）

資料期間：

年 月份

共 頁，頁次： 之

單位：新台幣元

債券代號	買賣別	成交日	交割日	交易對象	成交面額	成交殖利率	成交金額 (除息金額)	應計利息	應收付金額	市價評估 損 益
小 計										
小 計										
合 計										

經辦：

業務主管：

_____公司 債券選擇權交易未到期交易明細表（日報）

資料日期： 年 月 日 共 頁，頁次： 之

單位：新台幣元

買賣別	標的債券代號	買權/賣權	成交日	到期日	交易對象	履約利率	權利金	標的債券面額
買 進 小 計								
賣 出 小 計								
合 計								

經辦： 業務主管：

_____公司 債券選擇權交易未到期交易明細表（月報）

資料日期： 年 月 共 頁，頁次： 之

買賣別	標的債券代號	買權/賣權	成交日	到期日	交易對象	履約利率	權利金	標的債券面額	市價評估損益
買 進 小 計									
賣 出 小 計									
合 計									

單位：新台幣元

經辦： 業務主管：

_____公司 債券選擇權交易營業日報表

成交日期： 年 月 日 共 頁，頁次： 之
單位：新台幣元

買賣別	買權/ 賣權	交易對象	標的 債券代號	交割 日	到期 日	履約利率	權利金	標的債券 面額
小計								
小計								
合計：								

製表： 覆核： 會計： 主管：

_____公司債券選擇權交易營業月報表

成交月份： 年 月 共 頁，頁次： 之
單位：新台幣元

買賣別	買權/ 賣權	標的 債券代號	總筆數	交割日	權利金合計	標的債券總面額
小計						
小計						
合計：						

製表： 覆核： 會計： 主管：

(總筆數：依債券代號及交割日統計)

○○○證券股份有限公司未到期利率衍生性商品交易契約明細表

資料期間： 年 月份 共 頁，頁次： 之

單位：千元新台幣

項目 契約編號	交易 屬性 ¹	契約 成交日	契約 到期 日	客戶名稱	起息日、換息週期與約定換息條件	契約名目 本金金額	已實現 損益 ²	未實現 損益 ²
合 計								

業務主管：

經辦：

- 註：(1) 交易屬性：長部位 (**long**)、短部位 (**short**) 依證券商自有資本比率制度相關規定認定，其為長部位者填記「L」、短部位填記「S」。
- (2) 已實現損益：係該契約已完成結算與交換之利息收付損益累計值。
未實現損益：係將該契約採用市價評估法 (**marked-to-market**) 計算之未實現利息收付損益。
- (3) 資料可依實際承作契約多寡跨頁印製，惟請註記頁次，並於最後列加總合計金額。
- (4) 本表請先依交易屬性，再依契約編號順序列記，本表並得以媒體檔案之方式向櫃檯買賣中心稽核部門申報。

○○○證券股份有限公司新台幣利率衍生性商品交易契約部位統計月報

資料期間： 年 月份

單位：千元新台幣

到期期間 \ 部位區分	長 (long) 部位	短 (short) 部位	淨部位 ¹
一年			
二年			
三年			
五年			
七年			
七年以上			
合	計 ²		
固定利率資產部位 ³		固定利率負債部位	
浮動利率資產部位		浮動利率負債部位	

業務主管：

經辦：

註： (1) 長部位 (long)、短部位 (short) 依證券商自有資本比率制度相關規定認定。

淨部位：係指未軋平之利率衍生性商品交易契約部位。(= long - short；為相同到期期間契約之軋沖，正值為淨長，負值為淨短)。

(2) 部位合計：不同到期天期區間淨部位間不再作正負值抵銷，而係以各淨部位名目本金金額絕對值加總計算之。

(3) 固定 (或浮動) 利率資產 (或負債) 部位：係指公司固定 (或浮動) 利率資產 (或負債) 之面值合計額。

(4) 本表得以媒體檔案之方式向本中心稽核部門申報。

○○○證券股份有限公司承作轉換公司債資產交換交易契約資料申報表

資料期間： 年 月份

共 頁，頁次： /

資料項目	契約編號				
1. 固定收益交易契約成交日					
2. 交易相對人名稱					
3. 固定收益交易契約名目本金餘額					
4. 固定收益交易約定交換利率					
5. 固定收益交易約定付息週期					
6. 固定收益交易契約到期日					
7. 固定收益交易契約到期償還金額					
8. 固定收益交易賣出轉換公司債名稱					
9. 固定收益交易契約成交日該轉換公司債之成交價格					
10. 固定收益交易轉換公司債面值合計					
11. 選擇權交易契約成交日					
12. 選擇權交易契約名目本金餘額					
13. 選擇權價格（以百元價格方式列示）					
14. 選擇權契約到期日					
15. 選擇權得履約轉換公司債數量（張）					
16. 該轉換公司債已承作資產交換固定收益交易之面值總計					
17. 該轉換公司債已承作資產交換選擇權交易之面值總計					
18. 該轉換公司債本月底尚未承作之面值總計					
備 註					

業務主管：

經辦：

註：本表得以媒體檔案之方式向本中心稽核部門申報。

證券公司承作轉換公司債資產交換固定收益端交易契約資料申報表

資料期間 /

共 頁
頁次

資料項目	契約編號	ASW	ASW	ASW	ASW	ASW	ASW	ASW	ASW
交易相對人名稱									
交易相對人統一編號									
該交易相對人承作同一標的契約名目									
本金總計									
契約成交日									
契約到期日									
約定交換利率									
該標的之利息補償金(百元價格)									
契約到期償還金額									
契約賣出轉換公司債名稱									
契約賣出轉換公司債當日市價									
契約名目本金									
該標的已承作ASW之面值總計									
該標的已承作ASO之面值總計									
契約賣出轉換公司債是否為本公司主辦承銷									

主管：

會計：

覆核：

製表：

證券公司承作轉換公司債資產交換選擇權端交易契約資料申報表

資料期間

/

共 頁
頁次

契	ASO	ASO	ASO	ASO	ASO	ASO	ASO	ASO
約編號								
資料項目								
交易相對人名稱								
交易相對人統一編號/身份證字號								
該交易相對人承作同一標的(註一)之轉債選擇權張數								
契約成交日								
契約到期日								
選擇權價格(百元價格)								
契約得履約轉換公司債張數								
契約標的轉換公司債名稱								
對應之ASW契約編號								
契約名目本金								
該標的已承作ASW之面值總計								
該標的已承作ASO之面值總計								
契約賣出轉換公司債是否由本公司主辦承銷								

註一：同一標的公司之轉債需合併計算，如雅新一承作80張，雅新二承作100張，共計180張

主管：

會計：

覆核：

製表：

○○○證券股份有限公司承作結構型商品交易契約資料月報表

資料期間： 年 月份 共 頁，頁次： /

資料項目	契約編號					
1. 交易類別 (註1)						
2. 契約成交日						
3. 契約到期日						
4. 交易相對人名稱及帳號						
5. 契約本金金額與幣別 (註2)						
6. 契約成交金額與幣別 (註2)						
7. 契約成交金額佔契約本金比率						
8. 契約到期時支付金額						
9. 連結標的資產名稱						
10. 期初投資本金之保障比率						
11. 總投資報酬率之計算方式						
備 註						

業務主管：

經辦：

註：

1. 請依交易類別 (新作、提解、到期) 個別加總合計金額，並與五之二相互勾稽。
2. 若為外幣，請於備註欄註明匯率及換算之新台幣金額。

○○○證券股份有限公司承作結構型商品交易契約部位月報表

交易類別：

資料期間： 年 月份

最新信用評級：

共 頁，頁次： 之

單位：千元新台幣／或外幣

資料項目 契約期間	上月底流通在外契約名目 本金	本月新增契約名目 本金	本月到期或提解契約名目 本金	本月底流通在外契約名目 本金
一年內				
一～二年				
二～三年				
三～五年				
五～七年				
七～十年				
十年以上				
合 計				
本月底淨值數額			本月底自有資本適足比率	

業務主管：

經辦：

註：本表請於交易類別標明申報之交易商品名稱，並依實際承作契約多寡列記之。本表得跨頁印製，惟請註記頁次，並於最後列加總合計金額。