

華僑及外國人以國內有價證券作為境外投資活動擔保品月報表範本

申報日期：

資料年月：

傳送機構：

擔保品提供者ID	擔保品收受者ID	擔保品管理者ID	擔保品證券代碼	擔保品數量	擔保品計價幣別	擔保品市值(等值美元)	擔保品價值(等值美元)	交易契約編號	契約總擔保品價值(等值美元)	契約應提擔保品金額(等值美元)	契約幣別	契約類別	起始日	到期日
Collateral Provider ID	Collateral Receiver ID	Collateral Manager ID	Security ID	Quantity	Currency Code	Market Value USD	Collateral Value USD	Underlying Deal ID	Total Collateral Value USD	Required Collateral USD	Deal Currency	Deal Type	Start Date	End Date
Fxxxxxxx	Fxxxxxxx							xxxxxx		2,000,000	USD	C	2023/1/3	2049/1/3
Fxxxxxxx	Fxxxxxxx							xxxxxx		2,000,000	USD	C	2023/1/3	2049/1/3
Fxxxxxxx	Fxxxxxxx							xxxxxx		2,000,000	USD	C	2023/1/3	2049/1/3
Fxxxxxxx	Fxxxxxxx							yyyyyy		3,000,000	JPY	S	2023/1/3	2039/1/3
Fxxxxxxx	Fxxxxxxx							yyyyyy		3,000,000	JPY	S	2023/1/3	2039/1/3

填表說明：

- 申報人：**華僑及外國人以國內有價證券作為境外投資活動擔保品操作辦法第五條第一項第一款所稱擔保品提供者之僑外資保管機構。
- 申報期限：**依同辦法第十一條規定，應於每月終了15日內申報。
- 申報資料範圍：**申報截至上月底(資料月底)華僑及外國人以國內有價證券作為境外投資活動擔保品尚未返還部分，請先依交易契約編號拆分，再依國內有價證券擔保品證券代碼逐筆申報。
- 交易契約編號：**由擔保品提供者自行編製，各交易契約編號(包括已到期契約)不得重複。
- 契約類別：**外幣資金借貸填報代號C，境外有價證券借貸填報代號S，境外衍生性金融商品交易填報代號D。

擔保品月報範本欄位定

項目	英文名稱	定義
擔保品提供者ID	Collateral Provider ID	擔保品提供者之外資編號
擔保品收受者ID	Collateral Receiver ID	擔保品收受者之外資編號
擔保品管理者ID	Collateral Manager ID	擔保品管理者申請辦理本項業務時，證交所為擔保品管理者所編製之身分編號
擔保品證券代碼	Security ID	擔保品國內上市櫃證券代碼
擔保品數量	Quantity	擔保品數量(以股為單位)
擔保品計價幣別	Currency Code	擔保品證券的計價幣別
擔保品市值(等值美元)	Market Value USD	擔保品數量*期末收盤價
擔保品價值(等值美元)	Collateral Value USD	將擔保品市值折價一定成數(Haircut)後，實際用於擔保之價值。
交易契約編號	Underlying Deal ID	申報人就關聯交易契約所編製的編號，各編號不得重複
契約總擔保品價值(等值美元)	Total Collateral Value USD	關聯交易契約全數擔保品價值加總(包括該契約之非國內證券擔保品與現金擔保品等)
契約應提擔保品金額(等值美元)	Required Collateral USD	關聯交易契約應提撥的擔保品價值，包括非由國內證券擔保品所擔保之部分
契約幣別	Deal Currency	關聯交易契約幣別
契約類別	Deal Type	關聯交易契約
起始日	Start Date	關聯交易契約開始由擔保品管理者管理的日期
到期日	End Date	關聯交易契約預計結束由擔保品管理者管理的日期

義

Definition	備註
Collateral Provider ID	
Collateral Receiver ID	
Collateral Manager ID	
Security ID	
Quantity of the Collateral	
Pricing Currency of the Collateral	
Month-end market value of the collateral	
Market value of the collateral after applying the haircut	
Unique ID for each underlying deal, ensuring no duplication among IDs	
Total value of collateral, including foreign securities and cash collaterals.	
Overall collateral value required for the underlying transactions	
Pricing currency of the underlying deal	
Type of the underlying deals, categorized as either cash lending, security lending, or derivative transactions	分為外幣資金借貸(C)，有價證券借貸(S)及衍生性金融商品交易(D)
Start date of the underlying deal being managed by the triparty agent	
Expected end date of the underlying deal being managed by the triparty agent, which can be either a specific date or an open-ended arrangement	可為特定日期或開放式

## A11-擔保品提供者以國內有價證券作為境外投資活動擔保品之申報資料

## A11上傳檔案格式

序號	欄位名稱	欄位英文名稱	資料形式	長度	位址	說明
1	傳送機構		C(5)	5	01:05	保管機構代號(1位英文+3位數字)
2	資料年月		9(6)	6	06:11	西元年月
3	報表代號		C(3)	3	12:14	A11
4	擔保品提供者ID	Collateral Provider ID	C(10)	10	15:24	1位英文+8位數字
5	擔保品收受者ID	Collateral Receiver ID	C(10)	10	25:34	1位英文+8位數字
6	擔保品管理者ID	Collateral Manager ID	C(5)	5	35:39	1位英文+3位數字
7	擔保品證券代號	Security ID	C(6)	6	40:45	6位英數字
8	擔保品數量	Quantity	9(14)	14	46:59	股數
9	擔保品計價幣別	Currency Code	C(3)	3	60:62	貨幣代號
10	擔保品市值(等值美元)	Market Value USD	9(15).9(2)	18	63:80	含小數點後2位
11	擔保品價值(等值美元)	Collateral Value USD	9(15).9(2)	18	81:98	含小數點後2位
12	交易契約編號	Underlying Deal ID	C(18)	18	99:116	
13	契約總擔保品價值(等值美元)	Total Collateral Value USD	9(15).9(2)	18	117:134	含小數點後2位
14	契約應提擔保品金額(等值美元)	Required Collateral USD	9(15).9(2)	18	135:152	含小數點後2位
15	契約幣別	Deal Currency	C(3)	3	153:155	貨幣代號
16	契約類別	Deal Type	C(1)	1	156:156	限填C(外幣資金借貸)、S(有價證券借貸)或D(衍生性金融商品交易)
17	起始日	Start Date	9(8)	8	157:164	西元年月日
18	到期日	End Date	9(8)	8	165:172	西元年月日
19	換行碼		Hex 0D0A			Carriage return & line feed

範例
K001
202303
A11
F12345678
F12345678
M001
2330
1234567
TWD
123456.78
123456.78
123456.78
123456.78
USD
C
20230410
20231231