

附件 1: 中资金融机构外汇资产负债统计表 (金融机构填报)

表一 中资金融机构外汇资金来源情况表  
( 年 月末)

填报机构名称 (盖章):

单位: 万美元

来源项目	本月账面余额	上月账面余额	备注
一、各项存款 (1)=(2)+(13)			
境内存款 (2)=(3)+(6)+(9)+(11)+(12)			
单位活期存款 (3)			
其中: 中资企业存款 (4)			
外商投资企业存款 (5)			
单位定期存款 (6)			
其中: 中资企业存款 (7)			
外商投资企业存款 (8)			
储蓄存款 (9)			
其中: 定期存款 (10)			
中央银行存款 (11)			
其他类存款 (12)			
境外存款 (13)			
二、卖出回购资产 (14)			
三、同业存放 (15)			
其中: 境外同业存放 (16)			
四、同业拆入 (17)			
其中: 境外同业拆入 (18)			
五、外汇借款 (19)=(20)+(22)+(24)			
短期借款 (20)			
其中: 境外短期借款 (21)			
中长期借款 (22)			
其中: 境外中长期借款 (23)			
向中央银行借款 (24)			
六、债券筹资 (25)=(26)+(28)			
短期债券筹资 (26)			
其中: 境外债券筹资 (27)			
中长期债券筹资 (28)			
其中: 境外中长期债券筹资 (29)			
七、应付及暂收款 (30)			
其中: 境外应付及暂收款 (31)			
八、外汇买卖 (32)			
其中: 结售汇 (33)			
九、证券业务款项 (34)			
十、保险业务款项 (35)=(36)+(37)+(38)			
预付保费 (36)			
各项赔付准备金 (37)			
存入保证金 (38)			
十一、衍生金融负债 (39)			
十二、其他外汇负债 (40)			
其中: 境外其他外汇负债 (41)			
十三、所有者权益 (42)			
其中: 当年损益 (43)			
实收资本 (44)			
其中: 境外实收资本 (45)			
合计			

填报人:

填报人电话:

复核人:

填报日期: 年 月 日

表二 中资金融机构外汇资金来源币种结构情况表

( 年 月末)

填报机构名称(盖章):

单位: 万美元

币种	短期负债 <sup>1</sup> ①	长期负债 <sup>1</sup> ②	所有者权益③	合计④=①+②+③	备注
美元					
欧元					
英镑					
日元					
加元					
澳元					
瑞士法郎					
港币					
其他货币					
合计					

填报人:

填报人电话:

复核人:

填报日期: 年 月 日

说明: 负债包括表一中除所有者权益之外的所有资金来源项目。其中, 表一中“外汇买卖”全部归属为短期负债。

表三 中资金融机构外汇资产总量表

( 年 月末)

填报机构名称(盖章):

单位: 万美元

项目	本月账面价值	上月账面价值	累计减值准备	备注
一、各项贷款(1)=(2)+(7)+(12)+(13)				
短期贷款(2)=(3)+(6)				
境内短期贷款(3)				
其中: 中资企业贷款(4)				
外商投资企业贷款(5)				
境外短期贷款(6)				
中长期贷款(7)=(8)+(11)				
境内中长期贷款(8)				
其中: 中资企业贷款(9)				
外商投资企业贷款(10)				
境外中长期贷款(11)				
进出口贸易融资(12)				
其他各项贷款(13)				
二、证券投资(14)=(15)+(16)+(17)+(18)				
股本类证券(15)				
债务类证券(16)				
证券投资基金(17)				
其他证券投资(18)				
三、股权投资(19)				
其中: 投资子公司(20)				
投资联营企业及合营企业(21)				
四、外汇存款(22)=(23)+(25)+(27)				
存放同业(23)				
其中: 存放境外同业(24)				
存放中央银行(25)				
其中: 缴存准备金(26)				
其他外汇存款(27)				
五、拆放同业(28)				
其中: 拆放境外同业(29)				
六、应收及预付款(30)				
其中: 境外应收及预付款(31)				
七、买入返售资产(32)				
八、衍生金融资产(33)				
九、库存现金(34)				
十、其他外汇资产(35)				
外汇资产分类合计 <sup>1</sup>				
外汇资产期限分类	-	-	-	-
外汇流动性资产				
外汇长期性资产				
期限分类合计 <sup>1</sup>				

填报人:

填报人电话:

复核人:

填报日期: 年 月 日

说明: 各列中的“外汇资产分类合计”与“期限分类合计”应分别对应相等。

表四 中资金融机构外汇资产币种结构情况表

填报机构名称(盖章):

( 年 月 日)

单位: 万美元

项目	账面价值										合计	备注	
	美元	欧元	日元	英镑	加元	澳元	港币	瑞士法郎	其他				
一、各项贷款													
(1)=(2)+(3)+(4)+(5)													
短期贷款(2)													
中长期贷款(3)													
进出口贸易融资(4)													
其他各项贷款(5)													
二、证券投资													
(6)=(7)+(8)+(9)+(10)													
股本类证券(7)													
债券类证券(8)													
证券投资基金(9)													
其他证券投资(10)													
三、股权投资(11)													
四、外汇存款													
(12)=(13)+(14)+(15)													
存放同业(13)													
存放中央银行(14)													
其他外汇存款(15)													
五、拆放同业(16)													
六、应收及预付款(17)													
七、买入返售资产(18)													
八、衍生金融资产(19)													
九、库存现金(20)													
十、其他外汇资产(21)													
外汇资产分类合计 <sup>1</sup>													
外汇资产期限分类													
外汇流动性资产													
外汇长期性资产													
期限分类合计 <sup>1</sup>													

填报人:

填报人电话:

复核人:

填报日期: 年 月 日

说明: 各列中的“外汇资产分类合计”与“期限分类合计”应分别对应相等。

表五 外汇证券投资明细表

( 年 月末)

填报机构名称(盖章):

单位: 万美元

项目	本月账面价值	上月账面价值	累计减值准备	重估损益	记入本年损益(年初至今)		备注
					本月余额	上月余额	
证券投资会计分类	-	-	-	-	-	-	
交易类(1)							
可供出售类(2)							
持有至到期(3)							
贷款及应收款(4)							
会计分类合计 <sup>1</sup> (5)=(1)+(2)+(3)+(4)							
证券投资类型细分							
债务类证券(6)=(7)+(14)							
境外债务类证券(7)=(8)+(9)+(11)							
政府类(8)							
机构类(9)							
其中: 房贷抵押证券(10)							
公司类(11)							
其中: 资产证券化产品(12)							
金融机构债券(13)							
境内债务类证券(14)							
股本类证券(15)=(16)+(19)							
境外股本类证券(16)=(17)+(18)							
优先股(17)							
普通股(18)							
境内股本类证券(19)=(20)+(21)							
优先股(20)							
普通股(21)							
证券投资基金(22)							
其中: 境内发行证券基金(23)							
其他证券投资(24)							
类型细分合计 <sup>1</sup> (25)=(6)+(15)+(22)+(24)							
债务类证券信用评级细分							
AAA级(26)							
A至AA级(含AA+, AA, AA-, A+, A, A-级)(27)							
BBB级(含BBB+, BBB, BBB-级)(28)							
BBB级以下(29)							
评级不可获取(30)							
信用评级细分合计 <sup>1</sup> (31)=(26)+(27)+(28)+(29)+(30)							

填报人:

填报人电话:

复核人:

填报日期: 年 月 日

说明: 各列中“会计分类合计”、“类型细分合计”与“信用评级细分合计”均应分别相等。

表六 持有衍生金融产品情况表  
( 年 月 末)

填报机构名称 (盖章):

单位: 万美元

项 目	名义价值		累计减值准备	重估损益	记入本年损益 (年初至今)		备注
	本月余额	上月余额			本月余额	上月余额	
外汇衍生金融产品 (1) = (2) + (4) + (6) + (8)							
外汇远期及期货 (2)							
其中: 产品涉及人民币 (3)							
外汇期权 (4)							
其中: 产品涉及人民币 (5)							
外汇掉期 (6)							
其中: 产品涉及人民币 (7)							
其他汇率结构化产品 (8)							
其中: 产品涉及人民币 (9)							
利率衍生金融产品 (10) = (11) + (12) + (13) + (14)							
利率远期及期货 (11)							
利率期权 (12)							
利率互换 (13)							
其他利率结构化产品 (14)							
信用衍生产品 (15)							
其中: 信用违约掉期 (CDS) (16)							
权益类衍生产品 (17)							
商品衍生产品 (18)							
其他 (19)							
合计 (20) = (1) + (10) + (15) + (17) + (18) + (19)							

填报人电话:

复核人:

填报日期: 年 月 日

# 表七 房利美 (Fannie Mae) 和房地美 (Freddie Mac) 资产持有情况表<sup>1</sup>

(      年      月末)

填报机构名称 (盖章):

单位: 万美元

项 目	名义价值		账面价值		累计减值 准备	重估损益	记入本年损益 (年初至今)		备注
	本月余额	上月余额	本月余额	上月余额			本月余额	上月余额	
债券 (1) = (2) + (3) + (4)									
无抵押债券 (2)									
机构担保的房贷抵押债券 (3)									
可转换债券 (4)									
股票 (5) = (6) + (7)									
优先股 <sup>2</sup> (6)									
普通股 <sup>2</sup> (7)									
其他 (8)									
合计 (9) = (1) + (5) + (8)									

填报人:

填报人电话:

复核人:

填报日期:

说明:

1. 本表各项统计包括以抵押品等形式持有的资产, 例如通过证券出借、买入返售资产等方式持有的相关资产。
2. 优先股和普通股的名义价值按持有股数填列。

表八 信用违约掉期 (CDS) 产品持有情况表

( 年 月末)

填报机构名称 (盖章):

单位: 万美元

项 目	总头寸 <sup>1</sup> ①=②+③		净头寸 <sup>1</sup>				累计减值准备	重估损益	记入本年损益 (年初至今)		备注
	本月余额	上月余额	多头头寸 <sup>2</sup>		空头头寸 <sup>3</sup>				本月余额	上月余额	
			本月余额	上月余额	本月余额	上月余额					
交易对手细分 <sup>2</sup>											
排名											
1											
2											
3											
4											
5											
其他交易对手											
交易对手细分合计											
期限细分											
1年以内 (不含1年)											
1至5年 (不含5年)											
5年以上											
期限细分合计											

填报人:

填报人电话:

复核人:

填报日期:

说明:

1. 总头寸和净头寸均按名义价值填写。
2. 按总头寸名义价值进行排序, 前5名交易对手请填写交易对手名称。



表九 债务抵押债券(CDO)产品持有情况表

( 年 月末)

填报机构名称(盖章):

单位: 万美元

项 目	名义价值				累计减值准 备	重估损益	记入本年损益 (年初至今)		备注
	与CDS相关的CDO产 品①	其他CDO产品 ②	本月名义价值 ③=①+②	上月名义价 值			本月余额	上月余额	
信用评级细分	-	-	-	-	-	-	-	-	
AAA级									
AA级(含AA+, AA, AA-)									
A级(含A+, A, A-)									
BBB级(含BBB+, BBB, BBB-)									
BBB级以下									
评级不可获取									
信用评级细分合计 <sup>1</sup>									
期限细分	-	-	-	-	-	-	-	-	
1年以内(不含1年)									
1至5年(不含5年)									
5年以上									
期限细分合计 <sup>1</sup>									

填报人: 填报人电话:

复核人:

填报日期: 年 月 日

说明: 各列中“信用评级细分合计”与“期限细分合计”应分别对应相等。

### 表十 高风险外汇投资情况

( 年 月末)

填报机构名称 (盖章):

单位: 万美元

序号	发行机构/交易对手	发行机构/交易对手标识 (TICKER)	产品类别 <sup>1</sup>	本月初余额 <sup>2</sup>	上月初余额 <sup>2</sup>	累计减值准备	重估损益	记入本年损益 (年初至今)		备注
								本月初余额	上月余额	
1										
2										
3										
4										
5										
6										
7										
8										
...										

填报人:

填报人电话:

复核人:

填报日期: 年 月 日

说明:

1. 产品类别包括: A、拆放同业, B、外汇存款, C、外汇贷款, D、债券类证券, E、股本类证券, F、证券投资基金, G、股权投资, H、衍生金融产品, I、其他, 填写产品类别时仅填写A-I项, I项应在备注项列明具体项目。

2. 衍生金融产品的本月初余额与上月余额按照名义价值填写; 除衍生金融产品之外的资产按账面价值(已扣除累计减值准备)填写。