

附件 4:

中资金融机构外汇资产负债统计表汇总表 (分局填报)

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

机构名称	来源项目	本月账面余额	上月账面余额	备注	
XX银行	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: 当年结益 (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

机构名称	币种	短期负债 ^①	长期负债 ^②	所有者权益 ^③	合计 ^④ =①+②+③	备注
XX银行	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

机构名称	项目	本月账面价值	上月账面价值	累计减值准备	备注
XX银行	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 ¹					
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 ¹					

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
(年 月末)

填报机构名称 (盖章):

机构名称	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				
XX银行	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)													
	债务类证券(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 ¹														
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 ¹														

填报人:

填报人电话:

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

机构名称	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		
XX银行	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 ¹ (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 ¹ (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 ¹ (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

填报机构名称 (盖章):

(年 月 末)

单位: 万美元

机构名称	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
		本月初	上月末			本月初	上月末	
XX银行	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)								

复核人:

填报人电话:

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¹

(年 月末)

填报机构名称 (盖章):

单位: 万美元

机构名称	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	
XX 银行	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 ² (6)									
	普通股 ² (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

机构名称	项目	总头寸 ¹ ①=②+③		净头寸 ¹				累计减值准备	重估损益	计入本年损益(年初至今)		备注
		本月余额	上月余额	多头头寸②		空头头寸③				本月余额	上月余额	
				本月余额	上月余额	本月余额	上月余额					
XX银行	交易对手细分 ²	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	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列。
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

机构名称	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	
XX银行	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 ¹									
	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 ¹									

复核人:

填报人电话:

填报人:

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

机构名称	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 ¹	本月余额 ²	上月余额 ²	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	
XX银行	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、债务类证券, 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余额与上月余额按照名义价值填列; 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) 填列。