

金管會已核准銀行辦理涉及國內股權之衍生性 金融商品清單及申請程序說明

公告本會已核准銀行辦理之「銀行辦理衍生性金融商品業務應注意事項」(以下簡稱應注意事項)第七點第一項第一款(涉及國內股權)商品項目及申請程序說明如下：

一、銀行辦理下列涉及從事衍生自國內股價暨期貨交易所有關之現貨商品及指數等契約，除以外幣計價部分，應依中央銀行及本會規定辦理外，其餘項目銀行得逕依應注意事項第七點第二項規定，於申請書件、商品特性說明書、法規遵循聲明書及風險預告書送達本會之次日起十五日內，本會未表示反對意見者，即可逕行辦理；但銀行不得於該十五日期間內，辦理所申請之業務：

(一) 新臺幣計價部分

1. 涉及臺股股權相關標的之選擇權契約 (option)
2. 涉及臺股股權相關標的之交換契約 (swap)
3. 可轉換公司債資產交換
4. 本金連結臺股股權相關標的之選擇權組合型商品 (principle + option)
5. 本金連結臺股股權相關標的之交換組合型商品 (principle + swap)

(二) 外幣計價部分

1. 涉及臺股股權相關標的之選擇權契約 (option)
2. 涉及臺股股權相關標的之交換契約 (swap)
3. 涉及臺股股權相關標的之選擇權暨交換契約 (swap + option)
4. 可轉換公司債資產交換 (外幣利率交換與外幣可

轉換公司債買入選擇權結合)

5. 本金連結臺股股權相關標的之選擇權組合型商品
(principle + option)
6. 本金連結臺股股權相關標的之交換組合型商品
(principle + swap)
7. 本金連結臺股股權相關標的之選擇權暨交換組合
型商品 (principle + swap + option)

附表

型態	新臺幣計價	外幣計價
選擇權單項	○	○
交換單項	○	○
交換＋選擇權	—	○
本金＋選擇權	○	○
本金＋交換	○	○
本金＋交換＋選擇權	—	○
可轉換公司債資產交換	○	○

(已核准商品型態為○，尚未有銀行提出申請之商品型態為—)

說明：

1. 臺股股權相關標的指上市(櫃)單一個股、一籃子股票、ETF、臺灣證券交易所或證券櫃檯買賣中心公布之各類指數。
2. 衍生性商品標的涉及臺股股權者，其交易對象如涉及境外華僑及外國人者，應依本會 97 年 3 月 4 日金管證八字第 0970004657 號令、97 年 3 月 6 日金管證八字第 0970004713 號令等相關規定辦理。
3. 對於涉及連結國內股權之組合型(或結構型)商品及衍生性金融商品，如銀行及客戶以上市有價

證券契約交割者，應遵守證券交易法第 150 條、
本會 95 年 10 月 17 日金管證三字第 0950004674
號令及本會 97 年 5 月 30 日金管證三字第
0970019279 號令規定。

- 二、國際金融業務分行承作外幣計價涉及從事衍生自國內
股價暨期貨交易所有關之現貨商品及指數等契約，應另
依本會「銀行國際金融業務分行辦理衍生性金融商品業
務規範」向本會申請核准，由本會逐案洽商中央銀行辦
理。