別紙様式第二十七　（平23財令96・全改、令元財令９・令２財令69・一部改正）

・整理番号：作成者側の管理のための番号
・記載要領：別 紙 参

デリバティブ取引に関する報告書
（　　年　　月分）

新 潟 太 郎 殿
（日本銀行総裁）

報告区分（該当分に○）

	銀行 連結分
	信託 単体分

報告年月日：
報 告 者：
（名称及び
代表者の氏名
報告者の区分（該当分に○）
ア．銀行　イ．その他金融機関　ウ．その他
所在地：
連絡先：
報告者の氏名（電話番号）

（単位：百万円）

取引相手の所在国又は地域	オプション取引								先物取引及び先渡取引						スワップ取引に係る受払額						デリバティブ取引に伴う担保金又は預託金	
	店頭取引				取引所取引に係る証拠金等		店頭オプション取引に係る権利金相当額		店頭取引		取引所取引		店頭取引に係る想定元本額		通貨スワップ取引に係る元本交換額		為替、通貨又はキャピタルゲイン等		担保金預託率			
	買建プレミアム		売建プレミアム		受	払	買建	売建	受	払	受	払	買建	売建	受	払	受	払	受	払	受入担保金	差入担保金
	発現プレミアム	うち繰延	発現プレミアム	うち繰延							うち金利先渡取引											
合　　計																						

（記入要領）
1．別紙により記入すること。
2．「報告者の氏名」欄には、報告の責任について責任ある立場の者の氏名を記入すること。
3．連結算出を要する場合等において、銀行持株会社と傘下銀行等とそれぞれ別個に作成し「報告区分」欄の該当分に○印を記入すること。
4．各欄毎に小数点以下を記入すること。
5．「取引相手の所在国又は地域」欄については、日本、ケイマン諸島等の報告の単位に従い記入すること。
6．円以外の通貨については円に換算の上、記入すること。
7．単位未満については切捨て又は四捨五入の上、千万単位（百万円）までの数値を記入すること。
8．記入欄が不足する場合には、適宜欄を追加し、又は本様式を用いて当該不足する欄のみを記入し次葉として報告すること。
9．財務諸表等の規則、様式並びに作成方法に関する通知第８条第１項に規定するその他デリバティブ取引はオプション取引に準じて記入すること。

（日本銀行作成）