別紙様式第二十七　（平23財令96・全改、令元財令９・令２財令68・一部改正）

*[illegible]：[illegible]
*[illegible]：[illegible]

デリバティブ取引に関する報告書

（　　年　　月分）

[illegible]
（日本銀行総裁）

[illegible]区分（該当分に○）

	銀行 [illegible]
	信託 [illegible]

[illegible]：

[illegible]：

[illegible]：

[illegible]：

[illegible]区分（[illegible]）

[illegible]：

[illegible]：

[illegible]：

[illegible]（[illegible]）

（単位：百万円）

[illegible]	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保証金	
	売買高				期末時価に伴う価値増減		期末時価相当額		売買高				期末時価相当額		通貨スワップ取引に係る元本交換額		金利、通貨オプション等のキャッシュフロー等		期末時価相当額			
	発行プレミアム	うち記録	受取プレミアム	うち資産しない	受	払	プラス	マイナス	受	払	受	払	プラス	マイナス	受	払	受	払	プラス	マイナス	受入額	差入額
合　　計																						

（記入要領）
1．[illegible]記入すること。
2．「[illegible]」欄には、[illegible]について[illegible]記入すること。
3．[illegible]を[illegible]する場合等にあっては、[illegible]に準じ「[illegible]」欄の該当分に○印を記入すること。
4．[illegible]の区別を記入すること。
5．「[illegible]」欄は丁度、[illegible]月及び[illegible]の場合の場合に限り記入すること。
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．[illegible]については[illegible]記入の上、千[illegible]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、[illegible]を流用し、又は本様式を用いて当期不足する項のみを記入し次葉として報告すること。
9．[illegible]の処理、[illegible]に関する[illegible]その他デリバティブ取引はオプション[illegible]に準じて[illegible]すること。

（[illegible]）