

證券投資信託股份有限公司
保本型基金從事證券相關商品交易彙總表
年 月

單位：新臺幣元(第1頁/共1頁)

基金類型代號	基金代號	基金名稱	基金成立日期	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品種類 (註2)	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品契約內容 (註3)	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品未沖銷多空頭部位數量	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品契約價值或名目本金	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品未實現損益	期貨(或選擇權)、Swap、OTC證券相關商品保證金額 (註4)	基金資產中之利息 (註5)	基金資產中之未保本之本金	未沖銷多頭部位之期貨契約總市價 (A)	買進選擇權買權之總數(名目)價值 (B)	賣出選擇權賣權之總數(名目)價值 (C)	Swap、OTC證券相關商品之總名目價值 (D)	(A)+(B)+(C)+(D)占基金淨資產價值之比例	未沖銷空頭部位之期貨契約總市價 (E)	買進選擇權賣權之總數(名目)價值 (F)	賣出選擇權買權之總數(名目)價值 (G)	(E)+(F)+(G)占基金淨資產價值之比例	未沖銷之買進選擇權之權利金總額占基金淨資產價值之比例	持有以我國證券、證券組合或股價指數為標的之國內外交易所之期貨或選擇權交易，其未沖銷期貨契約總市價及選擇權契約總數(名目)價值之合計數，國內期貨市場部分占國外期貨市場部分之比例	持有未沖銷部位之各項契約，其於契約到期日結算加總後之最大可能損失占該基金資產中之利息或未保本之本金之比例	備註	
AF	DIO39	2028 REVERSO美元保本基金	2018/11/16	2028年到期選擇權(USD)	2028年到期選擇權(USD)	4,487,511	145,619,732	13,164,024		0	49,386,127				291,239,464	169.05						20.54		17.92	
AF	DIO39	2028 REVERSO美元保本基金	2018/11/16	NATIXIS RVS 20281120(NATIXIS RVS 20281120(USD))	NATIXIS RVS 20281120(NATIXIS RVS 20281120(USD))	1	145,619,732	-16,921,013		0	49,386,127				291,239,464	169.05						20.54		17.92	

註1：依據金管會107年8月28日金管證投字第1070326456號公告修訂。

註2：期貨或選擇權種類以台灣期貨交易所專用之英文代碼為準，惟個股選擇權之台灣期貨交易所專用英文代碼之第三碼一律為O。如為國外期貨(或選擇權)、Swap、OTC等證券相關商品，請填寫其中文及英文名稱。

註3：如為國外期貨(或選擇權)、Swap、OTC等證券相關商品，契約內容、未沖銷多空頭部位數量、契約價值(名目本金)、未實現損益、保證金帳戶總金額等各欄位均應填寫。

註4：基金資產中之利息為保本型基金因保本操作之需要，以定期存款存放於金融機構，所衍生之利息，取整數位。

註5：未保本之本金為保本型基金所定保本比率外之本金，取整數位。