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	基金資產中之利息 (註4)	基金資產中之未保本之本金 (註5)	未沖銷多頭部位 之期貨契約總市 值(A)	買進選擇 權買權之 總(名目) 價值(B)	賣出選擇 權賣權之 總(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 總市值(E)	買進選擇權賣權 之總(名目)價值 (F)	賣出選擇 權賣權之 總(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 總市值及選擇權契約 總(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)	4,287,511	139,159,745	18,522,162		0	55,437,361				278,319,490	158.25					19.23		7.15	
AF	DIO39	2028 REVERSO美元保本基金	2018/11/16	NATIXIS RVS 20281120NATIXIS RVS 20281120(USD)	NATIXIS RVS 20281120NATIXIS RVS 20281120(USD)	1	139,159,745	-14,653,521		0	55,437,361				278,319,490	158.25					19.23		7.15	

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。