

填報指示

港元銀行同業拆借成交量申報表 (表格MA(BS)11)

1.

填報認可機構的香港辦事處在申報表內指明的申報月份內訂約進行的港元銀行同業拆借成交量總額。

交易總額

2.

認可機構應參照交易日期(即成交日期或訂約日期)填報交易。舉例來說，於一九九三年十二月三十一日訂約，並於一九九四年一月三日結算的交易，應列入一九九三年十二月的申報表而不是一九九四年一月的申報表。

3.

借款和貸款總額應按本金額計算。假設向另一家銀行借出一筆10億港元貸款，為期一星期。到期時，本金連利息(例如是10.01億港元)續期一星期。這種情況應視作兩項交易處理。如兩項交易均列入同一個申報月份，借款和貸款總額應填報為20.01億港元(即原有本金10億港元，加新本金10.01億港元)。

4. 涉及購買或出售可轉讓債務工具的交易不應包括在內。

5. 填報數字應四捨五入為百萬港元。

掉期

6.

銀行同業市場中涉及港元的所有掉期交易均包括在內。就本申報表而言，只有在申報期內訂約的每項掉期合約的短期部分才應予以記錄。掉期合約中的短期部分如屬買入外幣賣出港元，應列入「貸款總額」一欄內；掉期合約中的短期部分如屬買入港元賣出外幣，則應列入「借款總額」一欄內。

對手方

7.

「香港認可機構」指在《銀行業條例》下的認可機構香港辦事處。「香港以外銀行」指在《銀行業條例》下的認可機構海外辦事處，以及獲註冊地的適當監管當局視作銀行的機構海外辦事處。

8.

即使與非銀行客戶進行的交易利率與同業利率一樣，也不應把這些交易包括在內。與外匯基金和中央銀行進行的交易也不應包括在內。

二十四小時通知

9.

對於須在二十四小時通知付還的交易，只應在完成交易的日期填報本金一次。不要在交易有效期內的任何其他日期再填報這項交易。

期限

10.

機構應按照市場慣例填報交易的期限。舉例來說，於一九九三年十二月二日訂約，為期一個月的貸款／借款，付還日期為一九九四年一月三日。由於一九九四年一月二日是公眾假期，所以按照市場慣，這項交易的期限應列為一個月期。

11.

以掉期交易而言，期限長短指取值日（短期部分）至到期日（長期部分）之期間。