

附件6

銀行新台幣匯率選擇權交易日報表

年 月 日

單位：千美元

交易型態	前日餘額 (0)	本日訂約 (1)	本日到期 (2)	本日餘額(3) (0)+(1)-(2)	選擇權交易對 外匯部位影響數 (Delta Position)	備 註
買入 Call					(A)	
賣出 Call					(B)	
買入 Put					(C)	
賣出 Put					(D)	
				Delta Position 淨 額	F=A+B+C+D	

經 辦 人：_____

聯絡電話：_____

註：本報表請併同『外匯部位日報表』逐日填報外匯局交易科

有權簽章人：_____