

(請填銀行名稱)

新台幣匯率選擇權交易日報表

DATE: _____ (日期格式: yyyy/mm/dd)

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) 0	

經辦人：(請填經辦人姓名)

聯絡電話：(請填聯絡電話)

註1:本報表請逐日向外匯局交易科申報。(填報詢問電話：23571174, 23571170)

註2:檔案命名規則為 option-XXX.xls (XXX為外匯局外匯交易科編列之銀行代號)