

Bank_Name

銀行外匯部位日報表

總行字軌：〇〇

DATE：yyyy/mm/dd (格式: yyyy/mm/dd)

(註3)

單位:千美元

一、即期外匯部位

(一)即期外匯已交割部位

前日部位 (0)	與顧客交易			同業間 即期交易 (4)	同業間遠期 到期交割 (5)	本日即期外匯 已交割部位(6) (6)=(0)+(3)+(4)+(5)+ (3a)+(3b)	備註	調整項 1 自有資金(3a)	調整項2 匯差及其他(3b)
	買入外匯(1)	賣出外匯(2)	淨額(3) (3)=(1)-(2)						
			0			0			

(二)即期外匯尚未交割部位

類別	前日餘額 (0)	本日訂約 (1)	本日交割 (2)	本日餘額 (3)=(0)+(1)-(2)	本日即期外匯 未交割部位 (7)=(3)淨額	本日即期 外匯部位 (1)=(6)+(7)
買入外匯				0	0	0
賣出外匯				0		

二、遠期外匯部位

類別	前日餘額(0)		本日訂約(1)		本日交割(2)		本日餘額(3)=(0)+(1)-(2)		本日遠期外匯部位 (II)=(3)淨額
	與顧客交易	與同業交易	與顧客交易	與同業交易	與顧客交易	與同業交易	與顧客交易	與同業交易	
買入外匯							0	0	0
賣出外匯							0	0	

三、衍生性金融商品部位

(一)無本金交割遠匯部位

類別	前日餘額 (0)	本日訂約 (1)	本日到期結清 (2)	本日餘額 (3)=(0)+(1)-(2)	本日無本金交割 遠匯部位 (4)=(3)淨額	調整項3 (目前少用) (5)	衍生性金融商品部位 (III)=(4)+(6)+(5)
買入外匯				0	0		
賣出外匯				0			0

(二)新台幣匯率選擇權Delta部位(註)

本日匯率選擇權Delta部位(6)

四、本日外匯部位淨額：(即期外匯部位+遠期外匯部位+衍生性金融商品部位)

本日外匯部位淨額 (I+II+III)
0

五、銀行間換匯交易外匯餘額

類別	前日餘額(0)	本日訂約(1)	本日交割(2)	本日餘額(3) (0)+(1)-(2)
賣即期買遠期				0
買即期賣遠期				0

註：1. Delta部位請參閱『新台幣匯率選擇權交易日報表』第(F)項目。

單位:千美元

一、即期外匯部位

(一)即期外匯已交割部位

前日部位 (0)	與顧客交易			同業間 即期交易 (4)	同業間遠期 到期交割 (5)	本日即期外匯 已交割部位(6) (6)=(0)+(3)+(4)+(5)+(3a)+(3b)	備註 ANOTE	調整項 1 自有資金(3a)	調整項2 匯差及其他(3b)
	買入外匯(1)	賣出外匯(2)	淨額(3) (3)=(1)-(2)					Adj-1	Adj-2
BAL	AB	AS	ACUST	ABT	AFS	ABAL			

(二)即期外匯尚未交割部位

類別	前日餘額 (0)	本日訂約 (1)	本日交割 (2)	本日餘額 (3)=(0)+(1)-(2)	本日即期外匯 未交割部位 (7)=(3)淨額	本日即期 外匯部位 (I)=(6)+(7)
買入外匯	BAL_UNB	A_UNC1	A_UNS1	ABAL_UNB	AUNST	SPOT
賣出外匯	BAL_UNB	A_UNC2	A_UNS2	ABAL_UNB		

二、遠期外匯部位

類別	前日餘額(0)		本日訂約(1)		本日交割(2)		本日餘額(3)=(0)+(1)-(2)		本日遠期外匯部位 (II)=(3)淨額
	與顧客交易	與同業交易	與顧客交易	與同業交易	與顧客交易	與同業交易	與顧客交易	與同業交易	
買入外匯	BAL_FB1	BAL_FB2	A_FC1	A_FC2	A_FS1	A_FS2	ABAL_FB1	ABAL_FB2	FORWARD
賣出外匯	BAL_FB3	BAL_FB4	A_FC3	A_FC4	A_FS3	A_FS4	ABAL_FB3	ABAL_FB4	

三、衍生性金融商品部位

(一)無本金交割遠匯部位

類別	前日餘額 (0)	本日訂約 (1)	本日到期結清 (2)	本日餘額 (3)=(0)+(1)-(2)	本日無本金交割 遠匯部位 (4)=(3)淨額	調整項3 (目前少用) (5)	衍生性金融商品部位 (III)=(4)+(6)+(5)
買入外匯	BAL_NB1	A_NC1	A_NS1	ABAL_NB1	NDF	adj-3	
賣出外匯	BAL_NB2	A_NC2	A_NS2	ABAL_NB2			

(二)新台幣匯率選擇權Delta部位(註)

本日匯率選擇權Delta部位(6)
A_OPTION

四、本日外匯部位淨額：(即期外匯部位+遠期外匯部位+衍生性金融商品部位)

本日外匯部位淨額 (I + II + III)
POS

五、銀行間換匯交易外匯餘額

類別	前日餘額(0)	本日訂約(1)	本日交割(2)	本日餘額(3) (0)+(1)-(2)
賣即期買遠期	BAL_SW1	A_SWC1	A_SWS1	ABAL_SW1
買即期賣遠期	BAL_SW2	A_SWC2	A_SWS2	ABAL_SW2

註： 1. Delta部位請參閱『新台幣匯率選擇權交易日報表』第(F)項目。

2. 所有「前日部位」、「前日餘額」欄位，填報金額必需與前一日申報的「本日」餘額相符。

3. 銀行總行字軌共2碼，為中央銀行外匯局核定之四碼英文字軌中的二碼；本國銀行為字軌之前二碼，外商銀行為後二碼。

4. 檔案之命名規則，即總行英文字軌+英文字母P+資料日期MMDD，副檔名為TXT。