

外匯證券商外匯部位日報表

年 月 日

一、即期外匯部位

(一)即期外匯已交割部位

單位:千美元

前日部位 (0)	與顧客交易 (含SWAP、CCS即期部位)			銀行間市場 即期交易 (4)	本日即期外匯 已交割部位(5) (5)=(0)+(3)+(4)+(A)+(B)	調整項 1 自有資金(A)	調整項2 匯差及其他(B)
	買入外匯(1)	賣出外匯(2)	淨額(3) (3)=(1)-(2)				

(二)即期外匯尚未交割部位(與顧客交易，含SWAP、CCS即期部位)

類別	前日餘額(0)	本日訂約(1)	本日交割(2)	本日餘額(3) (3)=(0)+(1)-(2)	本日即期外匯 未交割部位(6) (6)=(3)淨額	本日即期外匯 部位淨額 (7)=(5)+(6)
買入外匯						
賣出外匯						

二、換匯SWAP、標準型換匯換利CCS之遠期部位 (與顧客交易)

類別	前日餘額(0)	本日訂約(1)	本日交割(2)	本日餘額(3) (3)=(0)+(1)-(2)	本日SWAP、CCS 遠期交易部位 (4)=(3)淨額
買入外匯					
賣出外匯					

Delta部位

三、新台幣匯率選擇權Delta部位(註)

四、本日外匯部位淨額：(即期外匯部位+SWAP、標準型CCS之遠期部位+新台幣匯率選擇權Delta部位)

本日外匯部位淨額

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) (3)=(0)+(1)-(2)
賣即期買遠期				
買即期賣遠期				

(註)Delta部位請參閱『新台幣匯率選擇權交易日報表』第F欄。

有權簽章人：_____
經辦人：_____
聯絡電話：_____

填報項目內容與欄位名稱對照表

BANK 外匯證券商外匯部位日報表

DATE : YYYYMMDD (格式: yyyyymmdd)

一、即期外匯部位

(一)即期外匯已交割部位

單位:千美元

前日部位 (0)	與顧客交易 (含SWAP、CCS即期部位)			銀行間市場 即期交易 (4)	本日即期外匯 已交割部位(5) (5)=(0)+(3)+(4)+(A)+(B)	調整項 1 自有資金(A)	調整項2 匯差及其他(B)
	買入外匯(1)	賣出外匯(2)	淨額(3) (3)=(1)-(2)				
BAL	AB	AS	ACUST	ABT	ABAL	Adj-1	Adj-2

(二)即期外匯尚未交割部位(與顧客交易, 含SWAP、CCS即期部位)

類別	前日餘額(0)	本日訂約(1)	本日交割(2)	本日餘額(3) (3)=(0)+(1)-(2)	本日即期外匯 未交割部位(6) (6)=(3)淨額	本日即期外匯 部位淨額 (7)=(5)+(6)
買入外匯	BAL_UNB	A_UNC1	A_UNB1	ABAL_UNB	AUNST	SPOT
賣出外匯	BAL_UNB	A_UNC2	A_UNB2	ABAL_UNB		

二、換匯SWAP、標準型換匯換利CCS之遠期部位 (與顧客交易)

類別	前日餘額(0)	本日訂約(1)	本日交割(2)	本日餘額(3) (3)=(0)+(1)-(2)	本日SWAP、CCS 遠期交易部位 (4)=(3)淨額
買入外匯	BAL_FB1	A_FC1	A_FS1	ABAL_FB1	FORWARD
賣出外匯	BAL_FB3	A_FC3	A_FS3	ABAL_FB3	

Delta部位

A_OPTION

三、新台幣匯率選擇權Delta部位(註)

本日外匯部位淨額

POS

四、本日外匯部位淨額：(即期外匯部位+SWAP、標準型CCS之遠期部位+新台幣匯率選擇權Delta部位)

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) (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)Delta部位請參閱『新台幣匯率選擇權交易日報表』第F欄。

有權簽章人：_____
經辦人：_____
聯絡電話：_____