

(外匯證券商名稱) 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)	

註:

1. 本表所稱新台幣匯率選擇權交易，係指依「證券業辦理外匯業務管理辦法」第60條規定辦理之交易。
2. 外匯證券商辦理本項業務於訂約或到期交割時，應填報於「本日訂約」或「本日交割」欄位。
3. 本項業務存續期間應按日填報本表，每日Delta position淨額應與外匯部位日報表之「新台幣匯率選擇權Delta部位」相互勾稽，兩張報表金額要一致。
4. Delta position 須依相關參數算出合理數值，不宜偏離市場情形。
5. 需以本局提供之標準excel檔案填報資料，並透過央行「金融資料網路申報系統」向本行進行申報。
(標準excel檔案格式請逕至央行「金融資料網路申報系統」下載)
6. 外匯證券商申報之檔案名稱，命名規則為 option-XXX-mmdd.xls (XXX為交易科編列之證券商代號, mmdd為資料日期)

交易科 證券商 (名稱/英文代碼/數字代號) 對照表

	證券商名稱	英文代碼	數字代號