

換匯及標準型換匯換利交易遠期部位日報表

資料傳輸檔案格式

英數字: ASCII CODE; 中文: BIG-5

FROM	TO	FIELD NAME	欄位內容	PIC	NOTE
1	8	DATA-DATE	交易資料日期	X(08)	交易日報所列日期 (YYYY係西元年)
9	10	BANK	證券商總行	X(02)	依中央銀行核定之英文字軌編列
11	11	ITEM	類別	9(01)	1-2, 9 (註1)
			賣出即期買入遠期S/B		
12	19	B-BAL-PREV-N	前日餘額	S9(7)	(註2) A
20	27	B-CONTRACT-N	本日訂約金額	S9(7)	(註2) B
28	35	B-CONTRACT-C	本日訂約展期金額	S9(7)	(註2) C
36	43	B-SETTLE-N	本日交割金額	S9(7)	(註2) D
44	51	B-SETTLE-C	本日交割展期金額	S9(7)	(註2) E
52	59	B-BREACH-C	本日交割未履約金額	S9(7)	(註2) F
60	67	B-BALANCE-N	本日餘額	S9(7)	(註2) G
			買入即期賣出遠期B/S		
68	75	S-BAL-PREV-N	前日餘額	S9(7)	(註2) A
76	83	S-CONTRACT-N	本日訂約金額	S9(7)	(註2) B
84	91	S-CONTRACT-C	本日訂約展期金額	S9(7)	(註2) C
92	99	S-SETTLE-N	本日交割金額	S9(7)	(註2) D
100	107	S-SETTLE-C	本日交割展期金額	S9(7)	(註2) E
108	115	S-BREACH-C	本日交割未履約金額	S9(7)	(註2) F
116	123	S-BALANCE-N	本日餘額	S9(7)	(註2) G

註1: ITEM (即「類別」欄位)的分類代號:

代號	類別
1	換匯 SWAP
2	標準型CCS
9	合計

註2: PIC欄中, 'S' 為金額正負符號, 一個位元, 空白表示正值, '-' 表示負值; 9(07)各欄金額均以千美元為單位。

說明: 1. "前日餘額" 應與前一營業日之 "本日餘額" 相同

2. "前日餘額" 與 "本日餘額" 均不可為負數

3. "本日餘額" 應等於 "前日餘額" + "本日訂約金額" + "本日訂約展期金額" - "本日交割金額" - "本日交割展期金額" - "本日交割未履約金額" (G = A + B + C - D - E - F)

4. 若須作調整只能調在各訂約或交割金額欄內, 不可調整在前日或本日餘額中。

5. 上傳檔案名稱之命名規則, 為總行英文字軌前2碼+英文字母L+資料日期MMDD, 副檔名為 txt