

附件1

銀行外匯部位日報表

年 月 日

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)	備註
	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

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) (7)=(A)-(B)	本日即期外匯部位 (8) (8)=(6)+(7)
買入外匯				(A)		
賣出外匯				(B)		

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 (4)=(A)+(B)-(C)-(D)
	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							(A)	(B)	
賣出外匯							(C)	(D)	

三、NDF及Delta部位

(一)無本金交割遠匯部位(NDF)

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) (A)-(B)	備註
買入外匯				(A)		
賣出外匯				(B)		

本日匯率選擇權Delta部位(5)

(二)新台幣匯率選擇權Delta部位(註)-----

NDF及Delta部位  
(6)=(4)+(5)

本日外匯部位淨額

四、本日外匯部位淨額:即期外匯部位+遠期外匯部位+NDF及Delta部位-----

五、銀行間換匯交易及標準型換匯換利交易餘額

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				
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。

經辦人: \_\_\_\_\_ 聯絡電話: \_\_\_\_\_

有權簽章人 : \_\_\_\_\_