

外匯證券商外匯部位日報表資料傳輸格式說明

臺、檔案格式(file layout)

(資料共分成三列表示) (英數字: ASCII CODE; 中文: BIG-5)

列號	位 置	欄 名	總長度	小數	格 式	說明(請參照 excel「日報表與填報項目相對位置」工作表)
1	1~4	BANK	4		XXXX	依中央銀行核定之外匯證券商英文字軌編列
1	5~13	DATE	9		YYY/MM/DD	部位資料日期，中式年/月/日，例如：105/12/09
1	14~23	BAL	10	0	S9(9)	[即期已交割部位] 前日部位
1	24~33	AB	10	0	S9(9)	[即期已交割部位] [與顧客交易] 買入金額
1	34~43	AS	10	0	S9(9)	[即期已交割部位] [與顧客交易] 賣出金額
1	44~53	ACUST	10	0	S9(9)	[即期已交割部位] [與顧客交易] 買賣淨額
1	54~63	ABT	10	0	S9(9)	[即期已交割部位] 銀行間市場即期交易淨額
1	64~73	AFS				保留欄位，請填列空白
1	74~83	ABAL	10	0	S9(9)	本日即期外匯已交割部位
1	84~93	BAL_UNB	10	0	S9(9)	[即期未交割部位] [前日餘額] 買入金額
1	94~103	BAL_UNB	10	0	S9(9)	[即期未交割部位] [前日餘額] 賣出金額
1	104~113	A_UNC1	10	0	S9(9)	[即期未交割部位] [本日訂約] 買入金額
1	114~123	A_UNC2	10	0	S9(9)	[即期未交割部位] [本日訂約] 賣出金額
1	124~133	A_UNB1	10	0	S9(9)	[即期未交割部位] [本日交割] 買入金額
1	134~143	A_UNB2	10	0	S9(9)	[即期未交割部位] [本日交割] 賣出金額
1	144~153	ABAL_UNB	10	0	S9(9)	[即期未交割部位] [本日餘額] 買入金額
1	154~163	ABAL_UNB	10	0	S9(9)	[即期未交割部位] [本日餘額] 賣出金額
1	164~173	AUNST	10	0	S9(9)	本日即期外匯未交割部位
1	174~183	SPOT	10	0	S9(9)	本日即期外匯部位淨額
1	184~193	Adj-1	10	0	S9(9)	調整項 1→ 影響即期部位之自有資金
1	194~203	Adj-2	10	0	S9(9)	調整項 2→ 匯差及其他
1	204~213	Adj-3				保留欄位，請填列空白
2	1~4	BANK	4		XXXX	依中央銀行核定之證券商英文字軌編列
2	5~13	DATE	9		YYY/MM/DD	部位資料日期，中式年/月/日，例如：105/12/09
2	14~23	BAL_FB1	10	0	S9(9)	[SWAP、CCS 遠期部位] [與顧客交易][前日餘額] 買入
2	24~33	BAL_FB2				保留欄位，請填列空白
2	34~43	BAL_FB3	10	0	S9(9)	[SWAP、CCS 遠期部位] [與顧客交易][前日餘額] 賣出
2	44~53	BAL_FB4				保留欄位，請填列空白
2	54~63	A_FC1	10	0	S9(9)	[SWAP、CCS 遠期部位] [與顧客交易][本日訂約] 買入
2	64~73	A_FC2				保留欄位，請填列空白
2	74~83	A_FC3	10	0	S9(9)	[SWAP、CCS 遠期部位] [與顧客交易][本日訂約] 賣出
2	84~93	A_FC4				保留欄位，請填列空白
2	94~103	A_FS1	10	0	S9(9)	[SWAP、CCS 遠期部位] [與顧客交易][本日交割] 買入

2	104~113	A_FS2				保留欄位，請填列空白
2	114~123	A_FS3	10	0	S9(9)	[SWAP、CCS 遠期部位] [與顧客交易][本日交割] 賣出
2	124~133	A_FS4				保留欄位，請填列空白
2	134~143	ABAL_FB1	10	0	S9(9)	[SWAP、CCS 遠期部位] [與顧客交易][本日餘額] 買入
2	144~153	ABAL_FB2				保留欄位，請填列空白
2	154~163	ABAL_FB3	10	0	S9(9)	[SWAP、CCS 遠期部位] [與顧客交易][本日餘額] 賣出
2	164~173	ABAL_FB4				保留欄位，請填列空白
2	174~183	FORWARD	10	0	S9(9)	本日 SWAP、CCS 遠期交易部位
2	184~213					保留欄位，請填列空白
3	1~4	BANK	4		XXXX	依中央銀行核定之證券商英文字軌編列
3	5~13	DATE	9		YYY/MM/DD	部位資料日期，中式年/月/日，例如：105/12/09
3	14~103					保留欄位，請填列空白
3	104~113	A_OPTION	10	0	S9(9)	本日新臺幣匯率選擇權 Delta 部位
3	114~123					保留欄位，請填列空白
3	124~133	POS	10	0	S9(9)	本日外匯部位淨額
3	134~143	BAL_SW1	10	0	S9(9)	[銀行間換匯交易] [前日餘額] 賣即期買遠期金額
3	144~153	BAL_SW2	10	0	S9(9)	[銀行間換匯交易] [前日餘額] 買即期賣遠期金額
3	154~163	A_SWC1	10	0	S9(9)	[銀行間換匯交易] [本日訂約] 賣即期買遠期金額
3	164~173	A_SWC2	10	0	S9(9)	[銀行間換匯交易] [本日訂約] 買即期賣遠期金額
3	174~183	A_SWS1	10	0	S9(9)	[銀行間換匯交易] [本日交割] 賣即期買遠期金額
3	184~193	A_SWS2	10	0	S9(9)	[銀行間換匯交易] [本日交割] 買即期賣遠期金額
3	194~203	ABAL_SW1	10	0	S9(9)	[銀行間換匯交易] [本日餘額] 賣即期買遠期金額
3	204~213	ABAL_SW2	10	0	S9(9)	[銀行間換匯交易] [本日餘額] 買即期賣遠期金額

貳、說明

- 證券商應以自身的買賣方向填報；填報資料各欄位間之相關性，請參考部位日報表之「填報項目內容與欄位名稱對照表」說明。
 - 每一項金額單位：以千美元計。
 - 數值資料，在所屬位置內，靠右放置。正/負符號可緊接在數字之前；或固定放在最左側，不足位數時，則正/負號與數值之間補 0；正符號可以不表示。
 - 所有填報資料之前日部位、前日餘額等項目，其金額必需與前一營業日申報的「本日」餘額相符；若需調整前一營業日之買賣、訂約交割等金額，只能調在各買賣、訂約交割金額欄內，不可調整在前日或本日餘額欄中。
 - 為與銀行申報資料格式一致，及預留將來擴展需要，請依格式說明，於保留欄位中填列空白。
- ※6. 檔案名稱之命名規則為總行英文字軌前 2 碼+英文字母 P+資料日期 MMDD，副檔名為 txt。傳檔至本行資訊處「外匯資料處理系統」。