

銀行新台幣匯率選擇權交易日報表

年 月 日

單位：千美元

交易型態	前日餘額 (0)	本日訂約 (1)	本日到期 (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	F=A+B+c+D
					淨額	

註：本報表請併同『外匯部位日報表』逐日填報外匯局交易科

經辦人：_____

聯絡電話：_____

有權簽章人：_____

銀行新台幣匯率選擇權交易月報表

年 月

單位：千美元

一、對象別

交易對象 型態	國內同業	國內法人顧客	國外法人顧客	本月合計
買入				
賣出				
合計				

二、期限別

交易型態 期限	買入	賣出	本月合計
未逾3個月			
逾3個月且未逾6個月			
逾6個月且未逾1年			
逾1年且未逾5年			
5年以上			
合計			

註：本月報表請於次月十日前送達外匯局簽證科。

銀行名稱 _____

主管簽章 _____

經辦人簽章 _____

聯絡電話 _____