

F

SECRET
高度機密

Co. No. 代號										MM 月			YY 年		

(For Official Use Only)
(只供本局填寫)

under the Banking Ordinance
and the Monetary Statistics Ordinance
根據銀行業條例及
金融資料統計條例

FOREIGN CURRENCY POSITION OF AN AUTHORIZED INSTITUTION
認可機構持有外匯情況

As at
截至 (last day of the month)
本月最後一日

Name of Authorized Institution 認可機構名稱	Date of Submission 遞交日期
--	----------------------------

The Banking Ordinance and the Monetary Statistics Ordinance
銀行業條例及金融資料統計條例

Return required under section 63(2) of the Banking Ordinance and Section 3(2) of the Monetary Statistics Ordinance to be submitted to the Monetary Authority not later than 21 days after the last day of each calendar month.

根據銀行業條例第63(2)條及金融資料統計條例第3(2)條規定本申報表須於每月最後一天起計21天內交回金融管理局。

Note: This return is to be prepared in accordance with the completion instructions issued by the Monetary Authority.

註：本申報表須按金融管理局發出的填報指示填寫。

We certify that this return is, to the best of our knowledge and belief, correct.
我們據所知及確信，證明本申報表內容均屬正確無誤。

Chief Accountant
會計主任

Chief Executive
行政總裁

Name
姓名

Name
姓名

Name and telephone number of responsible person who may be contacted by the Monetary Authority in case of any query.

金融管理局有疑問時可聯絡的負責人姓名和電話號碼。

Name
姓名

Telephone Number
電話號碼

Part I - Foreign Currency Position (excluding options)
第I部 - 外匯盤(期權除外)

(HK\$ million 港幣百萬元)

Currency 貨幣	Positions of Hong Kong offices 本港辦事處外匯盤						Net long (short) position (b) 長(短)盤淨額(b)			
	Spot assets 現貨資產	Spot liabilities 現貨負債	Forward purchases 遠期買入	Forward sales 遠期賣出	Net long (short) position 長(短)盤淨額	Structural assets (liabilities) 結構性資產(負債) (a)	Overseas branches 海外分行	Subsidiaries 附屬公司 (c)	Consolidated position 綜合額	Consolidated structural assets (liabilities) 綜合結構性資產(負債)
	1	2	3	4	5(=1-2+3-4)	6	7	8	9(=5+7+8)	10
US dollars 美元	USD									
Pound sterling 英鎊	GBP									
Japanese yen 日圓	JPY									
Euro 歐元	EUR									
Canadian dollars 加拿大元	CAD									
Swiss francs 瑞士法郎	CHF									
Australian dollars 澳洲元	AUD									
Singapore dollars 新加坡元	SGD									
New Zealand dollars 紐西蘭元	NZD									
Gold 黃金	GOL									
Foreign currencies not separately specified above 以上未列出的外幣										
Hong Kong dollars 港元	HKD									
Sum of net long/short positions 淨長 / 短盤總額										
USD/HKD position 美元 / 港元盤										
Adjusted sum of net long/short positions 調整後的淨長 / 短盤總額										

- (a) Report the structural positions booked in the Hong Kong offices only. 只須填報本港辦事處帳面的結構性項目。
 (b) Columns 7 to 10 are for completion by locally incorporated institutions only. 第7至10欄僅供本港註冊機構填寫。
 (c) Banking subsidiaries and others substantially involved in foreign exchange trading. 從事銀行業的附屬機構和進行大量外匯買賣的其他附屬機構。

Part II(a) - Foreign Currency Position (Including options - "Model User" Approach)
 第II(a)部 — 外匯盤(包括期權在內 — 「模式使用者」方法)

(HK\$ million 港幣百萬元)

Section A A組			
Currency 貨幣	Net long (short) position 長(短)盤淨額	Adjusted options position 調整後的 期權盤額	Net long (short) position including options 包括期權的 長(短)盤淨額
	11	12	13 (=11+12)
US dollars 美元 USD			
Pound sterling 英鎊 GBP			
Japanese yen 日圓 JPY			
Euro 歐元 EUR			
Canadian dollars 加拿大元 CAD			
Swiss francs 瑞士法郎 CHF			
Australian dollars 澳洲元 AUD			
Singapore dollars 新加坡元 SGD			
New Zealand dollars 紐西蘭元 NZD			
Gold 黃金 GOL			
Foreign currencies not separately specified above 以上未列出的外幣			
Hong Kong dollars 港元 HKD			
Sum of net long/short positions 淨長 / 短盤總額			
USD/HKD position 美元 / 港元盤		Total USD/HKD position 美元 / 港元盤總額	
Adjusted sum of net long/short positions 調整後的淨長 / 短盤總額			

Section B B組			
Options written 賣出期權		Options held 持有期權	
Potential purchases 潛在買入額	Potential sales 潛在賣出額	Potential purchases 潛在買入額	Potential sales 潛在賣出額
14	15	16	17

Part II(b) - Foreign Currency Position (Including options - “Worst Case” Approach)
 第II(b)部 — 外匯盤(包括期權在內 — 「最壞情況」方法)

(HK\$ million 港幣百萬元)

		Section A A組				
Currency 貨幣		Net long (short) position 長(短)盤淨額	Options written 賣出期權		Potential open positions including options 包括期權的潛在未平倉盤	
			Potential purchases (+) 潛在買入額(+)	Potential sales (-) 潛在賣出額(-)	Potential long 潛在長盤	Potential short 潛在短盤
			11	12	13	14
US dollars 美元	USD					
Pound sterling 英鎊	GBP					
Japanese yen 日圓	JPY					
Euro 歐元	EUR					
Canadian dollars 加拿大元	CAD					
Swiss francs 瑞士法郎	CHF					
Australian dollars 澳洲元	AUD					
Singapore dollars 新加坡元	SGD					
New Zealand dollars 紐西蘭元	NZD					
Gold 黃金	GOL					
Foreign currencies not separately specified above 以上未列出的外幣						
Hong Kong dollars 港元	HKD					
Sum of net long/short positions 淨長 / 短盤總額			Maximum potential open position 最高潛在未平倉盤			
USD/HKD position 美元 / 港元盤			Total USD/HKD position 美元 / 港元盤總額			
Adjusted sum of net long/short positions 調整後的淨長 / 短盤總額			Adjusted maximum potential long/short position 調整後的最高潛在長 / 短盤			

Section B B組			
Options written 賣出期權		Options held 持有期權	
Potential purchases 潛在買入額	Potential sales 潛在賣出額	Potential purchases 潛在買入額	Potential sales 潛在賣出額
16	17	18	19

Part III - Exception Reports
 第III部 - 例外情況報告

(HK\$ million 港幣百萬元)

Currency 貨幣	Net long (short) positions/Net or potential open positions including options 長(短)盤淨額 / 包括期權的未平倉盤淨額或潛在未平倉盤							
	Date日期:	Date日期:	Date日期:	Date日期:	Date日期:	Date日期:	Date日期:	Date日期:
US dollars 美元	USD							
Pound sterling 英鎊	GBP							
Japanese yen 日圓	JPY							
Euro 歐元	EUR							
Canadian dollars 加拿大元	CAD							
Swiss francs 瑞士法郎	CHF							
Australian dollars 澳洲元	AUD							
Singapore dollars 新加坡元	SGD							
New Zealand dollars 紐西蘭元	NZD							
Gold 黃金	GOL							
Foreign currencies not separately specified above 以上未列出的外幣								
Hong Kong dollars 港元	HKD							
Sum of net long/short positions/ Maximum potential open position 淨長 / 短盤總額或最高潛在未平倉盤								
USD/HKD position 美元 / 港元盤								
Adjusted sum of net long/ short positions/ Adjusted potential long/short position 調整後的淨長 / 短盤總額或調整後的最高潛 在長 / 短盤								