

(2 जुलाई 2007 के जोखिम प्रबंध और अंतर बैंक लेनदेन पर जारी मास्टर परिपत्र का पैरा 6 (ग) देखें)

फॉरेन करेंसी ऑफ़िस पर रिपोर्ट:

[----- को समाप्त सप्ताह से संबंधित विकल्प लेनदेन रिपोर्ट]

**I. विकल्प लेनदेन रिपोर्ट**

| क्रम सं. | व्यापार तारीख | ग्राहक/पार्टी का नाम | आनुमानिक | क्रय/विक्रय विकल्प | स्ट्राइक | परि-पक्वता | प्रीमियम | प्रयोजन* |
|----------|---------------|----------------------|----------|--------------------|----------|------------|----------|----------|
|          |               |                      |          |                    |          |            |          |          |
|          |               |                      |          |                    |          |            |          |          |
|          |               |                      |          |                    |          |            |          |          |

\*व्यापार अथवा ग्राहक संबंधी तुलनपत्र का उल्लेख करें।

**II. विकल्प स्थिति रिपोर्ट**

| करेंसी पेयर                | अनुमानित बकाया            |                           | नेट पोर्टफोलियो डेल्टा | नेट पोर्टफोलियो गामा | नेट पोर्टफोलियो वेगा |
|----------------------------|---------------------------|---------------------------|------------------------|----------------------|----------------------|
|                            | क्रय                      | विक्रय                    |                        |                      |                      |
| अमरीकी डॉलर - भारतीय रुपया | अमरीकी डॉलर               | अमरीकी डॉलर               | अमरीकी डॉलर            |                      |                      |
| यूरो - भारतीय रुपया        | यूरो                      | यूरो                      | यूरो                   |                      |                      |
| जापानी येन - भारतीय रुपया  | जापानी येन - भारतीय रुपया | जापानी येन - भारतीय रुपया |                        |                      |                      |

(अन्य करेंसी पेयरो के लिए इसी प्रकार से)

टोटल नेट ओपन ऑफ़न पोज़िशन (आइएनआर)

अप्रैल 4, 2003 के एपी (डीआइआर) 92 में निर्धारित मेशोडालॉजी का उपयोग करके उपर्युक्त का पता लगाया जा सकता है।

### III. पोर्टफोलियो डेल्टा रिपोर्ट में परिवर्तन

भारतीय रुपए में स्पॉट में 0.25 प्रतिशत वृद्धि (₹ - वृद्धि) के लिए अमरीकी डॉलर - भारतीय रुपए डेल्टा में परिवर्तन

भारतीय रुपए में स्पॉट में 0.25 प्रतिशत वृद्धि (₹ - वृद्धि) के लिए अमरीकी डॉलर - भारतीय रुपए डेल्टा में परिवर्तन

इसी प्रकार, यूरो-भारतीय रुपए, जापानी येन-भारतीय रुपए, जैसी अन्य करेंसी पेयरो के लिए भारतीय रुपए में स्पॉट में 0.25 प्रतिशत परिवर्तन ( एफसीवाइ वृद्धि और मूल्य वस अलग) के लिए डेल्टा में परिवर्तन।

### IV. स्ट्राइक कंसंट्रेशन रिपोर्ट

| तय मूल्य | परिपक्वता समूह |          |         |       |       |         |
|----------|----------------|----------|---------|-------|-------|---------|
|          | 1 सप्ताह       | 2 सप्ताह | 1 महीना | 2 माह | 3 माह | > 3 माह |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |
|          |                |          |         |       |       |         |

यह रिपोर्ट चालू हाजिर स्तर के आसपास 150 पैसे के दायरे के लिए तैयार किया जाना चाहिए। संचयी स्थितियां दी जाए।

सभी राशियां मिलियन अमरीकी डॉलर में। जब बैंक कोई विकल्प स्वीकार करता है, राशि धनात्मक दर्शायी जाए। जब बैंक कोई विकल्प का विक्रय करता है तो राशि ऋणात्मक दर्शायी जाए।

सभी रिपोर्ट मार्केट मेकरों द्वारा ई-मेल के माध्यम से [fedcofmd@rbi.org.in](mailto:fedcofmd@rbi.org.in) को भेजी जाए। रिपोर्ट प्रत्येक शुक्रवार की स्थिति में तैयार की जाए तथा अगले सोमवार तक भेजी जाए।

