DIVA Labs.

# 遠期交易評估表

2024/4/30

**USD/NTD**

| Ref no. | tran. date | value date | currency (sell) | amt(USD: M) | spot | swap point | forward | FRD AMT (TWD: M) | A/C rate | F/X gain(loss) (NTD) | 估算MTM (NTD) | Bank | MTM Gain/Loss % | Note |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| LDF 113-037 | 113.04.08 | 113.05.08 | USD/NTD | 0.50 | 32.080 | (0.1150) | 31.965 | 15.983 | 31.862 | 51,500 | (269,645) | 彰化銀行 | -1.69% | SWAP |
| LDF 113-038 | 113.04.09 | 113.05.09 | USD/NTD | 0.50 | 32.076 | (0.1180) | 31.958 | 15.979 | 31.862 | 48,000 | (285,055) | 台新銀行 | -1.79% | SWAP |
| LDF 113-039 | 113.04.11 | 113.05.10 | USD/NTD | 0.50 | 32.070 | (0.1180) | 31.952 | 15.976 | 31.862 | 45,000 | (286,173) | 台新銀行 | -1.80% | SWAP |
| LDF 113-040 | 113.04.12 | 113.05.13 | USD/NTD | 0.50 | 32.201 | (0.1240) | 32.077 | 16.039 | 31.862 | 107,500 | (218,124) | 台新銀行 | -1.37% | SWAP |
| LDF 113-041 | 113.04.15 | 113.05.15 | USD/NTD | 0.50 | 32.300 | (0.1200) | 32.180 | 16.090 | 31.862 | 159,000 | (162,939) | 台新銀行 | -1.02% | SWAP |
| LDF 113-042 | 113.04.18 | 113.05.17 | USD/NTD | 0.80 | 32.378 | (0.1120) | 32.266 | 25.813 | 31.862 | 323,200 | (163,781) | 彰化銀行 | -0.64% | SWAP |
| LDF 113-043 | 113.04.19 | 113.05.20 | USD/NTD | 0.50 | 32.410 | (0.1250) | 32.285 | 16.143 | 31.862 | 211,500 | (87,295) | 彰化銀行 | -0.55% | SWAP |
| LDF 113-044 | 113.04.22 | 113.05.22 | USD/NTD | 0.50 | 32.510 | (0.1190) | 32.391 | 16.196 | 31.862 | 264,500 | (30,635) | 彰化銀行 | -0.19% | SWAP |
| LDF 113-045 | 113.04.23 | 113.05.23 | USD/NTD | 0.50 | 32.586 | (0.1250) | 32.461 | 16.231 | 31.862 | 299,500 | (2,762) | 玉山銀行 | -0.02% | SWAP |
| LDF 113-046 | 113.04.24 | 113.05.24 | USD/NTD | 0.50 | 32.484 | (0.1200) | 32.364 | 16.182 | 31.862 | 251,000 | (49,503) | 玉山銀行 | -0.31% | SWAP |
| LDF 113-047 | 113.04.25 | 113.05.27 | USD/NTD | 0.50 | 32.540 | (0.1240) | 32.416 | 16.208 | 31.862 | 277,000 | (8,964) | 彰化銀行 | -0.06% | SWAP |
| LDF 113-048 | 113.04.26 | 113.05.28 | USD/NTD | 0.50 | 32.540 | (0.1270) | 32.413 | 16.207 | 31.862 | 275,500 | (18,076) | 玉山銀行 | -0.11% | SWAP |
| LDF 113-049 | 113.04.29 | 113.05.29 | USD/NTD | 0.50 | 32.590 | (0.1210) | 32.469 | 16.235 | 31.862 | 303,500 | 11,629 | 玉山銀行 | 0.07% | SWAP |
| | | **Subtotal** | **USD** | **6.80** | 32.3670 | (0.1202) | **32.2468** | **219** | | **2,616,700** | **(1,571,323)** | | -0.73% | 不須公告 |
| | | **Total** | **USD** | **6.80** | **M** | **AVG** | **32.2468** | **219** | **Gain/(Loss)** | **2,616,700** | | | Acct. rate | 31.862 |
| | | | | | | | | | **MTM G/(L)** | **(1,571,323)** | | | Market rate | 32.545 |
| | | | | | | | | | | | TTL Gain/Loss % | | **-0.73%** | 不須公告 |

核准:

製表:

1. 依銀行的交易部位市價評估表 未實現損失 (NT$1,571,323)
2. 依集團政策維持避險比率 90% ~ 110% (實際部位 96 %)

報表編號： GXD2020　　彰　化　銀　行　客戶遠匯及換匯交易損益日報表　　列印日期： 2024/04/30
報表週期： 日報　　列印時間： 17:40:12
客戶統編： 89376900　　113 年 04 月 30 日　　頁　次： 000001
客戶名稱： 鈺緯科技開發股份有限公司　　資績行： 5647

| 契約編號 | 訂約日 | 到期日 | 種類 | 幣別 | 未交割餘額 | 訂約匯率 | 評估匯率 | 折現因子 | 評估損益（訂約幣） | 評估損益（基礎幣） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 3AQAH0600011U8 | 20240408 | 20240508 | 預售，換匯 | USD/TWD | 500,000.00 | 31.96500000 | 32.50442412 | 0.99975078 | -8,287.84 | -269,645 |
| 3AQAH0600007U9 | 20240418 | 20240517 | 預售，換匯 | USD/TWD | 800,000.00 | 32.26600000 | 32.47084030 | 0.99944176 | -5,033.99 | -163,781 |
| 3AQAH0600006UA | 20240419 | 20240520 | 預售，換匯 | USD/TWD | 500,000.00 | 32.28500000 | 32.45970618 | 0.99933837 | -2,683.11 | -87,295 |
| 3AQAH0600016U8 | 20240422 | 20240522 | 預售，換匯 | USD/TWD | 500,000.00 | 32.39100000 | 32.45231462 | 0.99926863 | -941.60 | -30,635 |
| 3AQAH0600017U6 | 20240425 | 20240527 | 預售，換匯 | USD/TWD | 500,000.00 | 32.41600000 | 32.43394524 | 0.99909144 | -275.52 | -8,964 |

| 加總 | 評估損益（訂約幣） | 評估損益（基礎幣） |
|---|---|---|
| TWD | | -560,320 |
| USD | -17,222.06 | |

本評估市價日報表供　貴客戶參考之用，提供截至 2024/04/30 止，貴公司與本行間所承作未到期交易之評估市價。

註 1：評估損益以基礎幣為計算基準，　OBU 客戶基礎幣為新臺幣　；　OBU 客戶基礎幣為美元。

註 2：為符合國際財務報導準則第 9 號「金融工具」（IFRS9）之規定，茲列示本評估市價日報表之評估損益，計算公式如下：
評估損益 =（訂約匯率 - 評估匯率）* 未交割餘額 * 折現因子 * 外幣折基礎幣匯率
若為預購交易，則未交割餘額為 -，若為預售交易，則未交割餘額為 +。

註 3：本評估市價日報表係依評價基準日，按本行認為合理之評價、　模型、　數據及市場價格所估算之結果。
如本表之損益為正數，表示　貴客戶衍生性金融商品部位之評價為利益；　如本表之損益為負數，表示　貴客戶衍生性金融商品部位之評價為損失。
本評估市價並非表示 (1) 可成立新交易之價格或，(2) 在市場成交或清算之價格或，(3) 提前中止任何雙方契約可得知之價格。
本行對本評估市價之計價模型或用以計算之市場資料的正確性，　及任何電腦或傳輸之錯誤或遺漏，　及對本評估市價日報表使用結果將不負任何責任。

註 4：本行評價基準日之參考即期匯率如下表所示：

| Currency Pair | EUR/USD | USD/HKD | USD/JPY | USD/TWD | EUR/TWD | HKD/TWD | JPY/TWD | GBP/TWD | GBP/USD | USD/CNH |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Rate | 1.0708 | 7.8265 | 156.7951 | 32.5350 | 34.8400 | 4.1570 | 0.2075 | 40.8400 | 1.2552 | 7.2477 |

註 5：配合「美國洗錢防制法（Anti-Money Laundry Act，　AMLA）」第 6308 條與增修訂「防制洗錢及打擊資恐」　約款規定，
本行金融交易總約定書及新臺幣與外幣間遠期外匯約定書（含蒐集、處理及利用個人資料告知事項）　等相關約據納入相關約定，
修訂條款公布於本行官方網站 (https://reurl.cc/85yrnd)。



台新國際商業銀行
Taishin International Bank

# 換匯交易部位市價評估表

客戶名稱： 鈺緯科技開發股份有限公司
客戶ＩＤ： 89376900

評價基準日： 2024/04/30
市價總值 ： -952,291
幣別 ： TWD

| 交易序號 | TMU單號 | 產品 | 交易日 | 生效日 | 到期日 | 遠期買入幣別 | 買入金額 | Discount Factor | 遠期賣出幣別 | 賣出金額 | Discount Factor | 即期匯率 | 遠期匯率 | 市價評估(TWD) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 13935469 | | SWAP | 2024/4/9 | 2024/4/9 | 2024/5/9 | TWD | 15,979,000 | 0.999738378 | USD | 500,000.00 | 0.998671789 | 32.076 | 31.958 | -285,055 |
| 13952219 | | SWAP | 2024/4/11 | 2024/4/11 | 2024/5/10 | TWD | 15,976,000 | 0.999705962 | USD | 500,000.00 | 0.998524431 | 32.07 | 31.952 | -286,173 |
| 13961758 | | SWAP | 2024/4/12 | 2024/4/12 | 2024/5/13 | TWD | 16,038,500 | 0.999604607 | USD | 500,000.00 | 0.998082622 | 32.201 | 32.077 | -218,124 |
| 13973930 | | SWAP | 2024/4/15 | 2024/4/15 | 2024/5/15 | TWD | 16,090,000 | 0.999537043 | USD | 500,000.00 | 0.997788303 | 32.3 | 32.18 | -162,939 |

【附註】

1. 本行評價基準日之即期參考匯率如下表所列。

| Currency Pair | USD/CNY | EUR/USD | USD/HKD | USD/JPY | USD/TWD | EUR/TWD | HKD/TWD | JPY/TWD | NZD/USD |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Rate | 7.2529 | 1.0703 | 7.82235 | 156.875 | 32.563 | 34.852179 | 4.162816 | 0.207573 | 0.59375 |
| Currency Pair | USD/CNH | AUD/USD | GBP/USD | USD/ZAR | CNY/TWD | AUD/TWD | GBP/TWD | ZAR/TWD | NZD/TWD |
| Rate | 7.2529 | 0.6528 | 1.2538 | 18.7201 | 4.489652 | 21.257126 | 40.827489 | 1.739467 | 19.334281 |
| Currency Pair | USD/RUB | RUB/TWD | USD/CAD | CAD/TWD | EUR/RUB | USD/VND | USD/PHP | USD/THB | |
| Rate | 93.205 | 0.34937 | 1.3694 | 23.779027 | 99.7573115 | 23082.5 | 57.775 | 37.055 | |

2. 此市價評估僅供客戶參考，並不代表實際解約時之價值。本市價評估表係於上載評價基準日按本行認為合理之評價、模型、數據及市場中價所估算出之結果，本行不保證其他交易商亦會提供相同之評價或報價。本表所示任何交易之參考評價不得作為本行就相同交易之報價或提前終止交易之實際清算價格，且本行就該參考評價之正確性或可靠性並未作任何聲明或保證。客戶如需解約，尚需考量解約當時之市場買賣價差、市場流動性、市場行情變動及平倉成本等因素，最終仍以本行交易室實際報價為準。

3. 上述均代表客戶的交易方向。

4.若Outstanding本金有細微差異，請以交易確認書上之本金數字為準。

**【地址變更通知】自西元2023年10月23日起，本行金融交易作業部搬遷至台北市大安區仁愛路四段1號6 樓，自前開日期起本行將以此新址作為收受通知之地址。**

如有疑問，請來電洽詢 台新銀行/法金作業處金融交易作業部 陳先生/吳小姐/劉小姐 TEL:(02)2173-2988 #5665#5675#5667

玉山銀行 E.SUN BANK

235 新北市中和區中山路二段351號9樓

EMail：angel_chian@diva.com.tw

鈺緯科技開發股份有限公司

江佳芬 經理
鈞啟

往來分行：1160
企金中心：C553

**評價原則**

本評價報告僅係供　貴顧客參考之用，本評價報告以本行Murex 衍生性金融商品模型為評價工具，其採用之市場資訊為評價日之市場報價，其採用之計算方式為市場所接受之合理計算方式，損益金額幣別之換算，係採即時折現匯率計算之。**如報表之損益為正數，表示　貴顧客衍生性金融商品部位之評價為利益，如報表損益為負數，表示　貴顧客衍生性金融商品部位之評價為損失。**　貴顧客如欲平倉該衍生性金融商品部位，或本交易因違約或其他不可抗力事件造成提前解約，其交易結算之實際條件及報價乃以最終簽署之合約及確認書所載為準。

**保證金追繳原則**

衍生性金融商品交易必須維持一定比例之保證金，當虧損達約定比例時，玉山銀行將向客戶發出追繳保證金通知，衍生性金融商品交易人應於玉山銀行發出追繳通知當日起至規定時限內補足所需追繳金額水準以上。

**停損原則**

若交易人未於追繳時限內補足保證金，或虧損觸及強制平倉水準時，本行得於以市價單方式反向平倉交易人所擁有之全部或部分部位。若玉山銀行已為通知之行為，但因不可歸責於本行之因素，致通知無法到達衍生性金融商品交易人時，本行仍得處分交易人之部位。

交易人交易糾紛申訴專線：(02)5579-9701

# 衍生性金融商品未到期交易部位評價報表　89376900

評價日期：2024/04/30

## 外匯換匯(FX Swap)

USD/TWD參考匯率：32.5420

| 交易編號 No | 交易日期 Trade Date | 期初交換日 ValueDate | 期末交換日 MaturityDate | 合約天期 Days | 剩餘天期 Remain | 交易幣別 Pairs | 預購金額 Buy Amt CCY1 | 預售金額 Sell Amt CCY1 | 期初交換匯率 Spot Rate | 期末交換匯率 Fwd Rate | 市場即期匯率 MarketSpotRate | 市場遠期匯率 MarketRate | 損益金額 PL Amt (USD) | 損益金額 PL Amt (TWD) | 使用額度 CreditLimit |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 3009265 | 2024/04/23 | 2024/04/23 | 2024/05/23 | 30 | 23 | USD/TWD | 0 | 500,000.00 | 32.586000 | 32.461000 | 32.5420 | 32.4665230 | -84.83 | -2,762 | H |
| 3011144 | 2024/04/24 | 2024/04/24 | 2024/05/24 | 30 | 24 | USD/TWD | 0 | 500,000.00 | 32.484000 | 32.364000 | 32.5420 | 32.4630070 | -1,520.70 | -49,503 | H |
| 3014849 | 2024/04/26 | 2024/04/26 | 2024/05/28 | 32 | 28 | USD/TWD | 0 | 500,000.00 | 32.540000 | 32.413000 | 32.5420 | 32.4491527 | -555.29 | -18,076 | H |
| 3017149 | 2024/04/29 | 2024/04/29 | 2024/05/29 | 30 | 29 | USD/TWD | 0 | 500,000.00 | 32.590000 | 32.469000 | 32.5420 | 32.4457416 | 357.24 | 11,629 | H |

**USD/TWD合計本金　預購：0　　預售：2,000,000.00**

**合計損益：USD -1,803.58**　　**合計損益：TWD -58,712**

**總合計損益：USD -1,803.58**　　**總合計損益：TWD -58,712**



列印時間：2024/4/30 下午04:41:12