DIVA Labs.

遠期交易評估表

2024/7/31

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 113-076	113.07.08	113.08.07	USD/NTD	0.50	32.456	(0.1100)	32.346	16.173	32.377	(15,500)	(235,686)	玉山銀行	-1.46%	SWAP
LDF 113-077	113.07.09	113.08.08	USD/NTD	0.50	32.470	(0.1100)	32.360	16.180	32.377	(8,500)	(226,948)	玉山銀行	-1.40%	SWAP
LDF 113-078	113.07.10	113.08.09	USD/NTD	0.50	32.570	(0.1150)	32.455	16.228	32.377	39,000	(177,750)	玉山銀行	-1.10%	SWAP
LDF 113-079	113.07.16	113.08.13	USD/NTD	0.50	32.580	(0.1050)	32.475	16.238	32.377	49,000	(160,400)	玉山銀行	-0.99%	SWAP
LDF 113-080	113.07.17	113.08.14	USD/NTD	0.50	32.610	(0.1050)	32.505	16.253	32.377	64,000	(171,927)	彰化銀行	-1.06%	SWAP
LDF 113-081	113.07.18	113.08.15	USD/NTD	0.50	32.550	(0.1110)	32.439	16.220	32.377	31,000	(174,747)	玉山銀行	-1.08%	SWAP
LDF 113-082	113.07.19	113.08.16	USD/NTD	0.50	32.650	(0.1090)	32.541	16.271	32.377	82,000	(121,926)	玉山銀行	-0.75%	SWAP
LDF 113-083	113.07.22	113.08.19	USD/NTD	0.50	32.730	(0.1050)	32.625	16.313	32.377	124,000	(102,964)	彰化銀行	-0.64%	SWAP
LDF 113-084	113.07.23	113.08.20	USD/NTD	0.50	32.795	(0.1100)	32.685	16.343	32.377	154,000	(42,725)	玉山銀行	-0.26%	SWAP
LDF 113-085	113.07.26	113.08.21	USD/NTD	0.50	32.795	(0.1040)	32.691	16.346	32.377	157,000	(66,412)	彰化銀行	-0.41%	SWAP
LDF 113-086	113.07.25	113.08.22	USD/NTD	0.50	32.761	(0.1100)	32.651	16.326	32.377	137,000	(56,153)	玉山銀行	-0.35%	SWAP
LDF 113-087	113.07.26	113.08.23	USD/NTD	0.50	32.761	(0.1020)	32.659	16.330	32.377	141,000	(78,831)	彰化銀行	-0.49%	SWAP
LDF 113-088	113.07.29	113.08.26	USD/NTD	0.50	32.785	(0.1030)	32.682	16.341	32.377	152,500	(62,011)	彰化銀行	-0.38%	SWAP
		Subtotal	**USD**	**6.50**	32.6548	(0.1076)	**32.5472**	**212**		**1,106,500**	**(1,678,480)**		-0.80%	不須公告
		Total	**USD**	**6.50**	**M**	**AVG**	**32.5472**	**212**	**Gain/(Loss)**	**1,106,500**			Acct. rate	32.377
									MTM G/(L)	**(1,678,480)**			Market rate	32.835
											TTL Gain/Loss %		**-0.80%**	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$1,678,480)
2. 依集團政策維持避險比率 90% ~ 110% (實際部位 95 %)

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：2024/07/31

外匯換匯(FX Swap)

USD/TWD參考匯率：32.8360

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
3112122	2024/07/08	2024/07/08	2024/08/07	30	7	USD/TWD	0	500,000.00	32.456000	32.346000	32.8360	32.8173720	-7,175.92	-235,686	H
3114075	2024/07/09	2024/07/09	2024/08/08	30	8	USD/TWD	0	500,000.00	32.470000	32.360000	32.8360	32.8138952	-6,909.86	-226,948	H
3115992	2024/07/10	2024/07/10	2024/08/09	30	9	USD/TWD	0	500,000.00	32.570000	32.455000	32.8360	32.8105000	-5,411.95	-177,750	H
3124284	2024/07/16	2024/07/16	2024/08/13	28	13	USD/TWD	0	500,000.00	32.580000	32.475000	32.8360	32.7958002	-4,883.70	-160,400	H
3129435	2024/07/18	2024/07/18	2024/08/15	28	15	USD/TWD	0	500,000.00	32.550000	32.439000	32.8360	32.7884939	-5,320.51	-174,747	H
3131649	2024/07/19	2024/07/19	2024/08/16	28	16	USD/TWD	0	500,000.00	32.650000	32.541000	32.8360	32.7848517	-3,712.27	-121,926	H
3136728	2024/07/23	2024/07/23	2024/08/20	28	20	USD/TWD	0	500,000.00	32.795000	32.685000	32.8360	32.7704500	-1,300.85	-42,725	H
3142490	2024/07/25	2024/07/25	2024/08/22	28	22	USD/TWD	0	500,000.00	32.761000	32.651000	32.8360	32.7633068	-1,709.70	-56,153	H

USD/TWD合計本金　預購：0　預售：4,000,000.00

合計損益：USD -36,424.76　　合計損益：TWD -1,196,335

總合計損益：USD -36,424.76　　總合計損益：TWD -1,196,335

列印時間：2024/7/31 下午04:41:39

報表編號： GXD2020　　彰　化　銀　行　客戶遠匯及換匯交易損益日報表

報表週期： 日報

客戶統編： 89376900　　113 年 07 月 31 日

客戶名稱： 鈺緯科技開發股份有限公司

列印日期： 2024/07/31
列印時間： 17:40:12
頁　　次： 000001
資續行　： 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）	匯率（外幣）
3AQAH0600016UB	20240717	20240814	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	32.50500000	32.84904266	0.99945408	-5,225.74	-171,927	
3AQAH0600017U9	20240722	20240819	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	32.62500000	32.83108256	0.99925301	-3,129.60	-102,964	
4AQAH0600018U1	20240726	20240821	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	32.69100000	32.82393372	0.99917169	-2,018.60	-66,412	
4AQAH0600019U1	20240726	20240823	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	32.65900000	32.81680506	0.99908985	-2,396.08	-78,831	
4AQAH0600020U0	20240729	20240826	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	32.68200000	32.80614950	0.99896613	-1,884.83	-62,011	

加總	評估損益（訂約幣）	評估損益（基礎幣）
TWD		-482,145
USD	-14,654.85	

本評估市價日報表供　貴客戶參考之用，提供截至 2024/07/31 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，　DBU 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	1.0823	7.8128	152.3853	32.9000	35.6100	4.2110	0.2159	42.2600	1.2844	7.2371

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)。

