DIVA Labs.

遠期交易評估表

2024/9/30

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 113-102	113.09.05	113.10.04	USD/NTD	0.50	32.075	(0.1110)	31.964	15.982	31.973	(4,500)	166,482	國泰世華	1.04%	SWAP
LDF 113-103	113.09.06	113.10.07	USD/NTD	0.50	32.025	(0.1180)	31.907	15.954	31.973	(33,000)	135,221	玉山銀行	0.85%	SWAP
LDF 113-104	113.09.09	113.10.08	USD/NTD	0.50	32.050	(0.1100)	31.940	15.970	31.973	(16,500)	153,118	玉山銀行	0.96%	SWAP
LDF 113-105	113.09.10	113.10.09	USD/NTD	0.50	32.175	(0.1100)	32.065	16.033	31.973	46,000	217,000	玉山銀行	1.36%	SWAP
LDF 113-106	113.09.11	113.10.11	USD/NTD	0.50	32.210	(0.1120)	32.098	16.049	31.973	62,500	236,368	玉山銀行	1.48%	SWAP
LDF 113-107	113.09.13	113.10.14	USD/NTD	0.50	32.070	(0.1160)	31.954	15.977	31.973	(9,500)	168,657	玉山銀行	1.05%	SWAP
LDF 113-108	113.09.16	113.10.16	USD/NTD	0.50	31.950	(0.1140)	31.836	15.918	31.973	(68,500)	112,507	玉山銀行	0.70%	SWAP
LDF 113-109	113.09.19	113.10.18	USD/NTD	0.50	32.060	(0.1010)	31.959	15.980	31.973	(7,000)	203,345	彰化銀行	1.27%	SWAP
LDF 113-110	113.09.20	113.10.21	USD/NTD	0.50	31.910	(0.1100)	31.800	15.900	31.973	(86,500)	101,656	玉山銀行	0.64%	SWAP
LDF 113-111	113.09.23	113.10.22	USD/NTD	0.50	31.980	(0.0960)	31.884	15.942	31.973	(44,500)	171,472	彰化銀行	1.07%	SWAP
LDF 113-112	113.09.24	113.10.23	USD/NTD	0.50	32.071	(0.0980)	31.973	15.987	31.973	0	191,011	玉山銀行	1.19%	SWAP
LDF 113-113	113.09.25	113.10.24	USD/NTD	0.50	31.910	(0.0880)	31.822	15.911	31.973	(75,500)	143,345	彰化銀行	0.90%	SWAP
LDF 113-114	113.09.26	113.10.25	USD/NTD	0.50	31.857	(0.0900)	31.767	15.884	31.973	(103,000)	117,307	彰化銀行	0.73%	SWAP
		Subtotal	**USD**	**6.50**	32.0264	(0.1057)	**31.9207**	**207**		**(340,000)**	**2,117,489**		1.02%	不須公告
		Total	**USD**	**6.50**	**M**	**AVG**	**31.9207**	**207**	**Gain/(Loss)**	**(340,000)**			Acct. rate	31.973
									MTM G/(L)	**2,117,489**			Market rate	31.650
											TTL Gain/Loss %		**1.02%**	不須公告

核准:

製表:

1. 依銀行的交易部位市價評估表 未實現利益 NT$2,117,489
2. 依集團政策維持避險比率 80% ~ 120%　　(實際部位 98 %)

國泰世華銀行
Cathay United Bank

鈺緯科技開發股份有限公司　　評價日: 2024/9/30

貴客戶：　　USD/TWD: 31.638

以下為貴公司與本行截至 2024/09/30 日止所承作且尚未到期交易之評估市價。所列示之市價評估金額係以　貴公司之損益立場表示：

FXSWAP　　（單位：元)

編號	訂約日	開始日	到期日	買入幣別	買入金額	賣出幣別	賣出金額	天數	訂約匯率	台幣評估價值	美金評估價值
8056996	2024/9/5	2024/9/5	2024/10/4	TWD	15,982,000.00	USD	500,000.00	29	31.964	166,482	5,262.09
									合計：	166,482	5,262.09

以上所列交易之評估市價係本行所作之評估，所列評估值係於上述日期該筆交易之估計市價。
所謂估計市價是按本行合理認定之財務標準，並參酌現在與未來市場情況、投資部位規模及流動性等相關條件後，以模型及／或假設所估算出之市價。
前述參考資料來源通常應屬可靠，然本行對此等資料並不負查證責任。如以其他計價模型及／或假設，或於其他不同時間而為評估，
極有可能產生完全相異之評估結果。任何評估市價皆可能受本行其他類似交易或本行報價之影響。本評估市價報告僅供　貴客戶參考。

本行茲此明示表示，對 (1) 本評估市價之計價模型、其所採用之市場資訊或評估值之正確性；(2) 於計算本評估市價所產生之任何錯誤或疏漏；及
(3) 任何因應用本評估市價所產生之結果，本行均不負任何責任。另，本評估市價並非表示 (1) 新成立交易之實際價格；
(2) 原交易在市場上成交或清算之實際價格；或 (3) 於提前終止本交易契約時預估所得收取之金額。
本評估市價與本行用以計算本行帳簿或會計帳務上投資部位或計算徵提擔保品之價值可能會有不同。

如　貴公司對本評估市價報告尚有任何不明之處，敬請於收到本評估市價報告後七日內與本行聯絡。

國泰世華商業銀行 金融市場作業部 Treasury Operations Department (5) Cathay United Bank

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　　往來分行：1160

鈞啟　　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：2024/09/30

外匯換匯(FX Swap)　　**USD/TWD參考匯率：31.6510**

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 CreditLimi
3204698	2024/09/06	2024/09/06	2024/10/07	31	7	USD/TWD	0	500,000.00	32.025000	31.907000	31.6510	31.6365586	4,271.43	135,221	H
3206564	2024/09/09	2024/09/09	2024/10/08	29	8	USD/TWD	0	500,000.00	32.050000	31.940000	31.6510	31.6337637	4,836.79	153,118	H
3208537	2024/09/10	2024/09/10	2024/10/09	29	9	USD/TWD	0	500,000.00	32.175000	32.065000	31.6510	31.6310000	6,854.72	217,000	H
3210801	2024/09/11	2024/09/11	2024/10/11	30	11	USD/TWD	0	500,000.00	32.210000	32.098000	31.6510	31.6252633	7,466.54	236,368	H
3214798	2024/09/13	2024/09/13	2024/10/14	31	14	USD/TWD	0	500,000.00	32.070000	31.954000	31.6510	31.6166861	5,327.63	168,657	H
3216390	2024/09/16	2024/09/16	2024/10/16	30	16	USD/TWD	0	500,000.00	31.950000	31.836000	31.6510	31.6109866	3,553.93	112,507	H
3222866	2024/09/20	2024/09/20	2024/10/21	31	21	USD/TWD	0	500,000.00	31.910000	31.800000	31.6510	31.5966871	3,211.18	101,656	H
3227030	2024/09/24	2024/09/24	2024/10/23	29	23	USD/TWD	0	500,000.00	32.071000	31.973000	31.6510	31.5909779	6,033.77	191,011	H

USD/TWD合計本金　預購：0　　預售：4,000,000.00

合計損益：USD 41,555.99　　**合計損益：TWD 1,315,538**

總合計損益：USD 41,555.99　　**總合計損益：TWD 1,315,538**

列印時間：2024/9/30 下午04:41:35

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： 2024/09/30
報表週期： 日報　　列印時間： 17:40:13
客戶統編： 89376900　　113 年 09 月 30 日　　頁　次： 000001
客戶名稱： 鈺緯科技開發股份有限公司　　實績行： 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）	匯率（外幣）
3AQAH0600017UB	20240919	20241018	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	31.95900000	31.55194058	0.99909412	6,434.97	203,345	
4AQAH0600018U3	20240923	20241022	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	31.88400000	31.54068094	0.99891035	5,426.33	171,472	
4AQAH0600019U3	20240925	20241024	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	31.82200000	31.53497206	0.99882086	4,536.23	143,345	
4AQAH0600020U2	20240926	20241025	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	31.76700000	31.53209796	0.99877671	3,712.25	117,307	

加總	評估損益（訂約幣）	評估損益（基礎幣）
TWD		635,469
USD	20,109.78	

本評估市價日報表供　貴客戶參考之用，提供截至 2024/09/30 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，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	1.1164	7.7736	142.4706	31.6000	35.2800	4.0650	0.2218	42.3000	1.3386	6.9911

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)。

彰化商業銀行 中和分行 匯外 (E)