DIVA Labs.

遠期交易評估表

2026/7/31

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 115-101	2026/7/3	2026/8/4	USD/NTD	0.50	31.900	(0.0730)	31.827	15.914	31.755	36,000	(232,474)	國泰世華	-1.46%	SWAP
LDF 115-102	2026/7/7	2026/8/5	USD/NTD	0.50	32.030	(0.0660)	31.964	15.982	31.755	104,500	(162,895)	國泰世華	-1.03%	SWAP
LDF 115-103	2026/7/8	2026/8/6	USD/NTD	0.50	32.150	(0.0660)	32.084	16.042	31.755	164,500	(101,862)	國泰世華	-0.64%	SWAP
LDF 115-104	2026/7/9	2026/8/7	USD/NTD	0.50	32.040	(0.0680)	31.972	15.986	31.755	108,500	(156,851)	國泰世華	-0.99%	SWAP
LDF 115-105	2026/7/10	2026/8/10	USD/NTD	0.50	32.040	(0.0710)	31.969	15.985	31.755	107,000	(155,613)	國泰世華	-0.98%	SWAP
LDF 115-106	2026/7/13	2026/8/11	USD/NTD	0.50	32.075	(0.0660)	32.009	16.005	31.755	127,000	(134,795)	國泰世華	-0.85%	SWAP
LDF 115-107	2026/7/14	2026/8/12	USD/NTD	0.50	32.190	(0.0660)	32.124	16.062	31.755	184,500	(76,201)	玉山銀行	-0.48%	SWAP
LDF 115-108	2026/7/15	2026/8/13	USD/NTD	0.50	32.190	(0.0660)	32.124	16.062	31.755	184,500	(75,159)	玉山銀行	-0.47%	SWAP
LDF 115-109	2026/7/16	2026/8/14	USD/NTD	0.50	32.170	(0.0640)	32.106	16.053	31.755	175,500	(83,121)	玉山銀行	-0.52%	SWAP
LDF 115-110	2026/7/17	2026/8/17	USD/NTD	0.50	32.170	(0.0680)	32.102	16.051	31.755	173,500	(82,051)	玉山銀行	-0.52%	SWAP
LDF 115-111	2026/7/20	2026/8/18	USD/NTD	0.50	32.280	(0.0630)	32.217	16.109	31.755	231,000	(23,541)	玉山銀行	-0.15%	SWAP
LDF 115-112	2026/7/21	2026/8/19	USD/NTD	0.50	32.280	(0.0630)	32.217	16.109	31.755	231,000	(22,539)	玉山銀行	-0.14%	SWAP
LDF 115-113	2026/7/22	2026/8/20	USD/NTD	0.50	32.280	(0.0630)	32.217	16.109	31.755	231,000	(21,545)	玉山銀行	-0.14%	SWAP
LDF 115-114	2026/7/23	2026/8/21	USD/NTD	0.50	32.330	(0.0650)	32.265	16.133	31.755	255,000	(85,289)	彰化銀行	-0.54%	SWAP
LDF 115-115	2026/7/24	2026/8/24	USD/NTD	0.50	32.290	(0.0700)	32.220	16.110	31.755	232,500	(104,821)	彰化銀行	-0.66%	SWAP
LDF 115-116	2026/7/27	2026/8/25	USD/NTD	0.50	32.370	(0.0670)	32.303	16.152	31.755	274,000	(62,391)	彰化銀行	-0.39%	SWAP
		Subtotal	**USD**	**8.00**	32.1741	(0.0666)	**32.1075**	**257**		**2,820,000**	**(1,581,148)**		-0.62%	不須公告
		Total	**USD**	**8.00**	**M**	**AVG**	**32.1075**	**257**	**Gain/(Loss)**	**2,820,000**			Acct. rate	31.755
									MTM G/(L)	**(1,581,148)**			Market rate	32.310
											TTL Gain/Loss %		**-0.62%**	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$ 1,581,148)
2. 依集團政策維持避險比率 80% ~ 120%　　(實際部位 96 %)