DIVA Labs.

遠期交易評估表

2024/7/15

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 113-067	113.06.19	113.07.17	USD/NTD	0.50	32.350	(0.1020)	32.248	16.124	32.377	(64,500)	(160,978)	彰化銀行	-0.99%	SWAP
LDF 113-068	113.06.20	113.07.18	USD/NTD	0.50	32.351	(0.1050)	32.246	16.123	32.377	(65,500)	(161,146)	玉山銀行	-1.00%	SWAP
LDF 113-069	113.06.21	113.07.19	USD/NTD	0.50	32.350	(0.1060)	32.244	16.122	32.377	(66,500)	(160,296)	玉山銀行	-0.99%	SWAP
LDF 113-070	113.06.24	113.07.22	USD/NTD	0.50	32.340	(0.1030)	32.237	16.119	32.377	(70,000)	(157,370)	彰化銀行	-0.97%	SWAP
LDF 113-071	113.06.25	113.07.23	USD/NTD	0.50	32.385	(0.1070)	32.278	16.139	32.377	(49,500)	(135,949)	玉山銀行	-0.84%	SWAP
LDF 113-072	113.06.26	113.07.24	USD/NTD	0.50	32.450	(0.1020)	32.348	16.174	32.377	(14,500)	(98,108)	彰化銀行	-0.61%	SWAP
LDF 113-073	113.06.27	113.07.26	USD/NTD	0.50	32.550	(0.1090)	32.441	16.221	32.377	32,000	(48,001)	彰化銀行	-0.30%	SWAP
LDF 113-074	113.06.27	113.07.29	USD/NTD	0.50	32.550	(0.1200)	32.430	16.215	32.377	26,500	(48,075)	彰化銀行	-0.30%	SWAP
LDF 113-075	113.06.28	113.07.25	USD/NTD	0.50	32.550	(0.1020)	32.448	16.224	32.377	35,500	(47,304)	玉山銀行	-0.29%	SWAP
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)	(75,142)	玉山銀行	-0.46%	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)	(66,380)	玉山銀行	-0.41%	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	(17,122)	玉山銀行	-0.11%	SWAP
		Subtotal	**USD**	**6.00**	32.4477	(0.1076)	**32.3401**	**194**		**(221,500)**	**(1,175,871)**		-0.61%	不須公告
		Total	**USD**	**6.00**	**M**	**AVG**	**32.3401**	**194**	**Gain/(Loss)**	**(221,500)**			Acct. rate	32.377
									MTM G/(L)	**(1,175,871)**			Market rate	32.575
											TTL Gain/Loss %		**-0.61%**	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$1,175,871)
2. 依集團政策維持避險比率 90% ~ 110% (待月底暫估再調整部位)

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：2024/07/15

外匯換匯(FX Swap)

USD/TWD參考匯率：32.5720

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
3087894	2024/06/20	2024/06/20	2024/07/18	28	3	USD/TWD	0.00	500,000.00	32.35100	32.246000	32.5720	32.5682916	-4,946.31	-161,146	H
3089854	2024/06/21	2024/06/21	2024/07/19	28	4	USD/TWD	0.00	500,000.00	32.35000	32.244000	32.5720	32.5645926	-4,920.23	-160,296	H
3094147	2024/06/25	2024/06/25	2024/07/23	28	8	USD/TWD	0.00	500,000.00	32.38500	32.278000	32.5720	32.5498982	-4,172.91	-135,949	H
3100629	2024/06/28	2024/06/28	2024/07/25	27	10	USD/TWD	0.00	500,000.00	32.55000	32.448000	32.5720	32.5426084	-1,451.98	-47,304	H
3112122	2024/07/08	2024/07/08	2024/08/07	30	23	USD/TWD	0.00	500,000.00	32.45600	32.346000	32.5720	32.4962844	-2,306.46	-75,142	H
3114075	2024/07/09	2024/07/09	2024/08/08	30	24	USD/TWD	0.00	500,000.00	32.47000	32.360000	32.5720	32.4927604	-2,037.51	-66,380	H
3115992	2024/07/10	2024/07/10	2024/08/09	30	25	USD/TWD	0.00	500,000.00	32.57000	32.455000	32.5720	32.4892440	-525.55	-17,122	H

USD/TWD合計本金　預購：0.00　預售：3,500,000.00

合計損益：USD -20,360.95　　**合計損益：TWD -663,339**

總合計損益：USD -20,360.95　　**總合計損益：TWD -663,339**

列印時間：2024/7/16 上午02:57:36

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： 2024/07/15
報表週期： 日報　　列印時間： 17:40:12
客戶統編： 89376900　　113 年 07 月 15 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）
3AQAH0600016UA	20240619	20240717	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	32.24800000	32.56998138	0.99991994	-4,941.46	-160,978	
3AQAH0600017U8	20240624	20240722	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	32.23700000	32.55182552	0.99972991	-4,830.71	-157,370	
4AQAH0600018U0	20240626	20240724	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	32.34800000	32.54428280	0.99965794	-3,011.57	-98,108	
4AQAH0600019U0	20240627	20240726	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	32.44100000	32.53704224	0.99958128	-1,473.46	-48,001	
4AQAH0600020U	20240627	20240729	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	32.43000000	32.52620096	0.99946586	-1,475.73	-48,075	

加總	評估損益（訂約幣）	評估損益（基礎幣）
TWD		-512,532
USD	-15,732.93	

本評估市價日報表供　貴客戶參考之用，提供截至 2024/07/15 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	1.0902	7.8066	157.9108	32.5770	35.5160	4.1730	0.2063	42.3000	1.2984	7.2635

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)。

