DIVA Labs.

遠期交易評估表

2025/7/31

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 114-089	2025/7/3	2025/8/5	USD/NTD	0.50	29.019	(0.0900)	28.929	14.465	29.155	(113,000)	(504,019)	國泰世華	-3.46%	SWAP
LDF 114-090	2025/7/7	2025/8/6	USD/NTD	0.50	29.018	(0.0840)	28.934	14.467	29.155	(110,500)	(500,114)	國泰世華	-3.43%	SWAP
LDF 114-091	2025/7/8	2025/8/7	USD/NTD	0.50	29.081	(0.0800)	29.001	14.501	29.155	(77,000)	(465,256)	國泰世華	-3.19%	SWAP
LDF 114-092	2025/7/9	2025/8/8	USD/NTD	0.50	29.070	(0.0790)	28.991	14.496	29.155	(82,000)	(457,495)	玉山銀行	-3.14%	SWAP
LDF 114-093	2025/7/10	2025/8/11	USD/NTD	0.50	29.070	(0.0840)	28.986	14.493	29.155	(84,500)	(456,500)	玉山銀行	-3.13%	SWAP
LDF 114-094	2025/7/11	2025/8/12	USD/NTD	0.50	29.280	(0.0830)	29.197	14.599	29.155	21,000	(349,770)	玉山銀行	-2.40%	SWAP
LDF 114-095	2025/7/14	2025/8/13	USD/NTD	0.50	29.245	(0.0780)	29.167	14.584	29.155	6,000	(363,546)	玉山銀行	-2.49%	SWAP
LDF 114-096	2025/7/15	2025/8/14	USD/NTD	0.50	29.378	(0.0780)	29.300	14.650	29.155	72,500	(295,819)	玉山銀行	-2.03%	SWAP
LDF 114-097	2025/7/16	2025/8/15	USD/NTD	0.50	29.385	(0.0790)	29.306	14.653	29.155	75,500	(291,596)	玉山銀行	-2.00%	SWAP
LDF 114-098	2025/7/17	2025/8/18	USD/NTD	0.50	29.460	(0.0800)	29.380	14.690	29.155	112,500	(234,619)	彰化銀行	-1.61%	SWAP
LDF 114-099	2025/7/18	2025/8/19	USD/NTD	0.50	29.460	(0.0850)	29.375	14.688	29.155	110,000	(252,251)	玉山銀行	-1.73%	SWAP
LDF 114-100	2025/7/21	2025/8/20	USD/NTD	0.50	29.401	(0.0820)	29.319	14.660	29.155	82,000	(279,050)	玉山銀行	-1.91%	SWAP
LDF 114-101	2025/7/22	2025/8/21	USD/NTD	0.50	29.449	(0.0770)	29.372	14.686	29.155	108,500	(235,033)	彰化銀行	-1.61%	SWAP
LDF 114-102	2025/7/23	2025/8/22	USD/NTD	0.50	29.420	(0.0790)	29.341	14.671	29.155	93,000	(249,340)	彰化銀行	-1.71%	SWAP
LDF 114-103	2025/7/24	2025/8/25	USD/NTD	0.50	29.320	(0.0820)	29.238	14.619	29.155	41,500	(297,292)	彰化銀行	-2.04%	SWAP
		Subtotal	**USD**	**7.50**	29.2704	(0.0813)	**29.1891**	**219**		**255,500**	**(5,231,700)**		-2.39%	不須公告
		Total	**USD**	**7.50**	**M**	**AVG**	**29.1891**	**219**	**Gain/(Loss)**	**255,500**			Acct. rate	29.155
									MTM G/(L)	**(5,231,700)**			Market rate	29.870
											TTL Gain/Loss %		**-2.39%**	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$ 5,231,700)
2. 依集團政策維持避險比率 80% ~ 120%　(實際部位 96 %)

國泰世華銀行
Cathay United Bank

鈺緯科技開發股份有限公司　　評價日: 2025/7/31

貴客戶：　　USD/TWD: 29.94

以下為貴公司與本行截至 2025/07/31 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
8420197	2025/7/3	2025/7/3	2025/8/5	TWD	14,464,500.00	USD	500,000.00	33	28.929	-504,019	-16,834.30
8423308	2025/7/7	2025/7/7	2025/8/6	TWD	14,467,000.00	USD	500,000.00	30	28.934	-500,114	-16,703.87
8425033	2025/7/8	2025/7/8	2025/8/7	TWD	14,500,500.00	USD	500,000.00	30	29.001	-465,256	-15,539.61
									合計：	-1,469,389	-49,077.79

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：2025/07/31

外匯換匯(FX Swap)

USD/TWD參考匯率：29.9160

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
3624083	2025/07/08	2025/07/09	2025/08/08	30	8	USD/TWD	0	500,000.00	29.070000	28.991000	29.9160	29.9059898	-15,287.03	-457,495	H
3624100	2025/07/08	2025/07/10	2025/08/11	32	11	USD/TWD	0	500,000.00	29.070000	28.986000	29.9160	29.8990000	-15,253.78	-456,500	H
3630031	2025/07/11	2025/07/11	2025/08/12	32	12	USD/TWD	0	500,000.00	29.280000	29.197000	29.9160	29.8965400	-11,687.44	-349,770	H
3631779	2025/07/14	2025/07/14	2025/08/13	30	13	USD/TWD	0	500,000.00	29.245000	29.167000	29.9160	29.8940912	-12,147.75	-363,546	H
3633658	2025/07/15	2025/07/15	2025/08/14	30	14	USD/TWD	0	500,000.00	29.378000	29.300000	29.9160	29.8916374	-9,884.68	-295,819	H
3635625	2025/07/16	2025/07/16	2025/08/15	30	15	USD/TWD	0	500,000.00	29.385000	29.306000	29.9160	29.8891924	-9,743.58	-291,596	H
3638017	2025/07/17	2025/07/18	2025/08/19	32	19	USD/TWD	0	500,000.00	29.460000	29.375000	29.9160	29.8795015	-8,428.87	-252,251	H
3641474	2025/07/21	2025/07/21	2025/08/20	30	20	USD/TWD	0	500,000.00	29.401000	29.319000	29.9160	29.8771010	-9,324.37	-279,050	H

USD/TWD合計本金　預購：0　　預售：4,000,000.00

合計損益：USD -91,757.50　　合計損益：TWD -2,746,027

總合計損益：USD -91,757.50　　總合計損益：TWD -2,746,027

列印時間：2025/7/31 下午04:42:18

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： 2025/07/31
報表週期： 日報　　列印時間： 17:40:12
客戶統編： 89376900　　114 年 07 月 31 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）
3AQAH0600017UL	20250717	20250818	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	29.38000000	29.84955630	0.99932213	-7,848.10	-234,619	
4AQAH0600018UD	20250722	20250821	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	29.37200000	29.84244694	0.99919120	-7,861.95	-235,033	
4AQAH0600019UD	20250723	20250822	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	29.34100000	29.84010658	0.99914643	-8,340.53	-249,340	
4AQAH0600020UC	20250724	20250825	預售，換匯	USD/TWD	500,000.00	29.23800000	29.83317384	0.99900868	-9,944.54	-297,292	

加總	評估損益（訂約幣）	評估損益（基礎幣）
TWD		-1,016,284
USD	-33,995.12	

本評估市價日報表供　貴客戶參考之用，提供截至 2025/07/31 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，　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	1.1430	7.8505	148.9536	29.8950	34.1700	3.8080	0.2007	39.6500	1.3263	7.1966

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）　等相關約定納入相關約定，
修訂條款公布於本行官方網站（https://reurl.cc/85yrnd）。

