



结构性存款产品评价表

评价日：2022/1/28

产品认购代码	产品名称	挂钩标的	起息日	到期日	流动性条款	产品规模	结构性存款产品市值 (百元计价)	衍生产品公允价值 (百元计价)
CNYLH2021120605	玉来鸿E系列 第十二期	美元Libor3M利率	2021/12/6	2022/3/9	不可提前赎回	9,060,000.00	100.88841	100.50472
CNYLH2021102904	玉来鸿D系列 第十三期	美元Libor3M利率	2021/10/29	2022/2/18	不可提前赎回	1,560,000.00	101.01071	100.72823
CNYLH2021112604	玉来鸿D系列 第十四期	美元Libor3M利率	2021/11/26	2022/2/28	不可提前赎回	40,000,000.00	100.89879	100.56367
CNYLH2021120304	玉来鸿D系列 第十五期	美元Libor3M利率	2021/12/3	2022/3/7	不可提前赎回	12,030,000.00	100.89812	100.51332
CNYLH2021121504	玉来鸿D系列 第十六期	美元Libor3M利率	2021/12/15	2022/3/18	不可提前赎回	50,000,000.00	100.88777	100.43846
CNYLH2021122404	玉来鸿D系列 第十七期	美元Libor3M利率	2021/12/24	2022/3/28	不可提前赎回	21,380,000.00	100.89652	100.31632
CNYLH2021123004	玉来鸿D系列 第十八期	美元Libor3M利率	2021/12/30	2022/4/7	不可提前赎回	35,580,000.00	100.93409	100.18092
CNYLH2022010705	玉来鸿E系列 第十三期	美元Libor3M利率	2022/1/7	2022/2/8	不可提前赎回	11,770,000.00	100.03069	100.31072
CNYLH2022011005	玉来鸿E系列 第十四期	美元Libor3M利率	2022/1/10	2022/4/13	不可提前赎回	20,000,000.00	100.85616	101.84251
EURUSD2021110101	玉来荟A系列 第五期	欧元兑美元即期汇率	2021/11/1	2022/2/9	不可提前赎回	24,370,000.00	100.94726	101.55596
EURUSD2021111001	玉来荟A系列 第六期	欧元兑美元即期汇率	2021/11/10	2022/2/10	不可提前赎回	22,890,000.00	100.89173	100.12512
EURUSD2021111701	玉来荟A系列 第七期	欧元兑美元即期汇率	2021/11/17	2022/2/17	不可提前赎回	32,130,000.00	100.90928	103.61485
EURUSD2022011201	玉来荟A系列 第八期	欧元兑美元即期汇率	2022/1/12	2022/4/14	不可提前赎回	11,620,000.00	100.83636	96.81633
EURUSD2022011801	玉来荟A系列 第九期	欧元兑美元即期汇率	2022/1/18	2022/4/20	不可提前赎回	2,140,000.00	100.82045	95.08877
EURUSD2022012501	玉来荟A系列 第十期	欧元兑美元即期汇率	2022/1/25	2022/4/27	不可提前赎回	7,840,000.00	100.84126	97.97684
EURUSD2022012801	玉来荟A系列 第十一期	欧元兑美元即期汇率	2022/1/28	2022/5/6	不可提前赎回	13,060,000.00	100.91071	100.02229

*揭示数据意为每一百元认购本金对应的估值
(折算公式: 认购本金 / 100 x 产品市值)

*衍生产品公允价值初值为100。(衍生产品公允价值-100)意为价值涨跌方向及幅度(如110意为衍生品公允价值涨10%)

持仓风险

顾客涉及风险如下:

信用风险、流动性风险、产品不成立风险、管理人风险、法律与政策风险、再投资风险、不可抗力风险、信息传递风险;
详见《风险揭示书》。

风险控制措施

玉山银行(中国)具备普通类衍生产品交易业务资格,针对结构性存款业务的风险特征,制定和实施相应的风险管理政策和程序,持续有效地识别、计量、监测和控制结构性存款业务面临的各类风险,并将结构性存款业务风险管理纳入全面风险管理体系。结构性存款按照存款管理,纳入存款准备金和存款保险保费的缴纳范围,相关资产按照国务院银行业监督管理机构的相关规定计提资本和拨备。玉山银行(中国)在销售文件中明确约定与顾客联络和信息披露的方式、渠道和频率,以及在信息披露过程中各方的责任,确保顾客及时获取信息。

评价原则:

本评价以结构性存款产品为评价对象。玉山银行(中国)不对本评价结果或由本行提供的市场资讯作任何声明或保证,本评价报告仅供顾客参考,顾客仍应谨慎判断。若因顾客违约或其他不可抗力事件造成提前解约,其交易结算的实际条款及金额以最终签署的合约与确认书为准。

交易咨询专线: 0755-88981313转3087/3052