



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

结构性存款产品评价表

评价日: 2022/6/30

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)
EURUSD2022040601	玉来荟A系列 第二十一期	欧元兑美元即期汇率	2022-04-06	2022-07-07	不可提前赎回	15,970,000.00	100.88101	104.32624
EURUSD2022041401	玉来荟A系列 第二十三期	欧元兑美元即期汇率	2022-04-14	2022-07-20	不可提前赎回	25,400,000.00	100.92232	101.31865
EURUSD2022042501	玉来荟A系列 第二十四期	欧元兑美元即期汇率	2022-04-25	2022-07-27	不可提前赎回	32,390,000.00	100.88904	103.16436
EURUSD2022051201	玉来荟A系列 第二十五期	欧元兑美元即期汇率	2022-05-12	2022-08-12	不可提前赎回	23,880,000.00	100.86698	102.76948
EURUSD2022052401	玉来荟A系列 第二十八期	欧元兑美元即期汇率	2022-05-24	2022-08-24	不可提前赎回	30,330,000.00	100.86178	101.74358
EURUSD2022053101	玉来荟A系列 第三十期	欧元兑美元即期汇率	2022-05-31	2022-08-31	不可提前赎回	25,340,000.00	100.84239	100.53298
EURUSD2022061401	玉来荟A系列 第三十一期	欧元兑美元即期汇率	2022-06-14	2022-09-14	不可提前赎回	34,450,000.00	100.83773	102.75570
EURUSD2022062101	玉来荟A系列 第三十二期	欧元兑美元即期汇率	2022-06-21	2022-09-21	不可提前赎回	22,650,000.00	100.84204	100.82968
EURUSD2022062201	玉来荟A系列 第三十三期	欧元兑美元即期汇率	2022-06-22	2022-07-27	不可提前赎回	39,100,000.00	100.29604	101.04541
EURUSD2022063001	玉来荟A系列 第三十四期	欧元兑美元即期汇率	2022-06-30	2022-09-30	不可提前赎回	64,420,000.00	100.83646	99.96855

*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意为衍生产品公允价值涨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。