

附表一：雷曼連動債(美國控股公司)依原始投資幣別各檔債券受償實際返還比例一覽表

商品名稱/ ISIN Number 國際證券編碼	本行信託持有 總金額(原幣)	美國雷曼 控股公司 承認債權 金額(美金)	美國雷曼控股公司受償分配比例 承認債權比例(美金)/實際債權比例(原幣)								美國雷曼 控股公司 累計實際受償 債權分配比例 原幣E A+B+C+D
			第一次 101/04/17		第二次 101/10/01		第三次 102/04/08		第四次 102/10/03		
			美金	原幣A	美金	原幣B	美金	原幣C	美金	原幣D	
農華富貴/ XS0341730363	USD 967,000	USD 967,000.00	3.6092%	3.6092%	2.4356%	2.4356%	3.0763%	3.0763%	3.6473%	3.6473%	12.7684%
12年CMS雙率區間/ XS0350635958	USD 6,190,000	USD 6,306,509.55	3.6092%	3.6772%	2.4356%	2.4814%	3.0763%	3.1342%	3.6473%	3.7160%	13.0088%
12年雙星得利/ XS0361383192	USD 1,060,000	USD 1,071,660.00	3.6092%	3.6489%	2.4356%	2.4624%	3.0763%	3.1102%	3.6473%	3.6874%	12.9089%
2年期澳幣區間按日計息/ XS0341031432	AUD 4,000,000	USD 3,269,641.62	3.6092%	2.8532%	2.4356%	1.9204%	3.0763%	2.4246%	3.6473%	3.1841%	10.3822%
4年期澳幣一起發/ XS0356420215	AUD2,782,000(註)	USD 2,252,561.84	3.6092%	3.7683%	2.4356%	2.5363%	3.0763%	3.2023%	3.6473%	4.2054%	13.7122%
2年期澳幣固定配息2/ XS0346508962	AUD 4,360,000	USD 3,552,611.14	3.6092%	2.8441%	2.4356%	1.9143%	3.0763%	2.4169%	3.6473%	3.1740%	10.3493%
2年期澳幣固定配息3/ XS0365300069	AUD 2,420,000	USD 1,965,457.69	3.6092%	2.8349%	2.4356%	1.9081%	3.0763%	2.4091%	3.6473%	3.1637%	10.3157%

註：4年期澳幣一起發以面額之75%價格發行，本行信託持有總面額為AUD2,782,000，實際信託投資總金額為AUD2,086,500(即AUD2,782,000\*75%)

美國雷曼控股公司(受償分配金額以『美元』計價入帳)

首次分配(101/04/17)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=0.9671澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價29.5/30.505)。

第二次分配(101/10/01)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=0.9646澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價32/30.395)。

第三次分配(102/04/08)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=0.9642澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價29.96/31.07)。

第四次分配(102/10/03)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=1.068澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價29.37/27.49)。

範例：陳君原申購2年期澳幣固定配息2連動債券(未和解)，信託金額澳幣20,000元，參與美國雷曼控股公司第四次分配款為例。

$$\begin{aligned} \text{本檔債券可分配受償金額} &= \text{承認債權金額} \times \text{承認債權比例} \\ &= \text{USD}3,552,611.14 \times 3.6473\% = \text{USD}129,574.99 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{本檔債券受償入帳金額} &= \left[ (\text{原申購信託金額} / \text{本行信託持有總金額}) \times \text{本檔債券可分配受償金額} \right] \\ &= \left[ (\text{AUD}20,000 / \text{AUD}4,360,000) \times \text{USD}129,574.99 \right] = \text{USD}594.38 \end{aligned}$$

(若您就所投資之雷曼連動債已與本行簽署和解協議者，您實際受分配款項將依和解協議內容辦理。)

$$\begin{aligned} \text{本檔債券實際受償金額} &= \text{本檔債券受償入帳金額} \times \text{匯率(美金/澳幣)} \\ &= \text{USD}594.38 \times 1.068 = \text{AUD}634.80 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{本檔債券實際已返還金額之分配比例} &= \text{本檔債券實際受償金額} / \text{原申購信託金額} \\ &= \text{AUD}634.80 / \text{AUD}20,000 = 3.174\% \end{aligned}$$

\*以上受償金額可能因小數點進位而有些差額。

附表二：雷曼連動債(荷蘭財務公司)依原始投資幣別各檔債券受償實際返還比例一覽表

商品名稱/ ISIN Number 國際證券編碼	全體投資人 持有總金額 (原幣)	本行信託持有 總金額(原幣)	荷蘭雷曼 財務公司 承認債權 金額(歐元)	荷蘭雷曼財務公司受償分配比例實際受償比例(原幣)				荷蘭雷曼 財務公司 累計實際受償 債權分配比例	雷曼債務人累計實際 受償分配比例 (美國控股&荷蘭財務)
				第一次表示性分配比例12.27% 102/05/08		第二次表示性分配比例4.779% 102/10/28			
				承認債權依表示性 分配比例換匯後 可分配金額 (原幣)	原幣F	承認債權依表示性 分配比例換匯後 可分配金額 (原幣)	原幣G		
農華富貴/ XS0341730363	USD 1,000,000	USD 967,000	EUR 721,560.31	USD 115,157.07	11.5157%	USD 46,864.17	4.6864%	16.2021%	28.9705%
12年CMS雙率區間/ XS0350635958	USD 6,220,000	USD 6,190,000	EUR 4,662,883.19	USD 744,170.60	11.9642%	USD 302,846.67	4.8689%	16.8331%	29.8419%
12年雙星得利/ XS0361383192	USD 1,060,000	USD 1,060,000	EUR 806,677.05	USD 128,741.24	12.1454%	USD 52,392.36	4.9427%	17.0881%	29.9970%
2年期澳幣區間按日計息/ XS0341031432	AUD 4,840,000	AUD 4,000,000	EUR 2,780,780.13	AUD 427,358.91	8.8297%	AUD 186,811.72	3.8597%	12.6895%	23.0717%
4年期澳幣一起發/ XS0356420215	AUD 2,782,000	AUD 2,782,000(註)	EUR 1,268,040.19	AUD 194,876.35	9.3399%	AUD 85,186.44	4.0827%	13.4226%	27.1348%
2年期澳幣固定配息2/ XS0346508962	AUD 4,420,000	AUD 4,360,000	EUR 2,545,855.02	AUD 391,254.89	8.8519%	AUD 171,029.54	3.8694%	12.7214%	23.0707%
2年期澳幣固定配息3/ XS0365300069	AUD 2,420,000	AUD 2,420,000	EUR 1,389,265.54	AUD 213,506.63	8.8226%	AUD 93,330.31	3.8566%	12.6792%	22.9949%

註：4年期澳幣一起發以面額之75%價格發行，本行信託持有總面額為AUD2,782,000，實際信託投資總金額為AUD2,086,500(即AUD2,782,000\*75%)

荷蘭雷曼財務公司(受償分配金額以『原申購幣別』計價入帳)

首次分配(102/05/08)：表示性分配比例係依可分配現金以2013.04.24每1美元=0.7688759歐元之匯率轉換為歐元後計算；分配金額轉換匯率係依雷曼網站公告為準(1美元=0.96296澳幣)。

第二次分配(102/10/28)：表示性分配比例係依可分配現金以2013.10.14每1美元=0.73578歐元之匯率轉換為歐元後計算；分配金額轉換匯率係依雷曼網站公告為準(1美元=1.03435澳幣)。

範例：陳君原申購2年期澳幣固定配息2連動債券(未和解)，信託金額澳幣20,000元，參與荷蘭雷曼財務公司第二次分配款為例。

$$\begin{aligned}
 \text{本檔債券受償入帳(實際)金額} &= \text{【承認債權依表示性分配比例換匯後可分配金額} \times (\text{本行信託持有總金額} / \text{全體投資人持有總金額}) \\
 &\quad \times (\text{原申購信託金額} / \text{本行信託持有總金額}) \text{】} \\
 &= \text{【AUD171,029.54} \times (\text{AUD4,360,000} / \text{AUD4,420,000}) \times (\text{AUD20,000} / \text{AUD4,360,000}) \text{】} \\
 &= \text{AUD773.89}
 \end{aligned}$$

(若您就所投資之雷曼連動債已與本行簽署和解協議者，您實際受分配款項將依和解協議內容辦理。)

$$\begin{aligned}
 \text{本檔債券實際已返還金額之分配比例} &= \text{本檔債券實際受償金額} / \text{原申購信託金額} \\
 &= \text{AUD773.89} / \text{AUD20,000} = \text{3.8694\%}
 \end{aligned}$$

\*以上受償金額可能因小數點進位而有些差額。