

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
		第一次 101/04/17		第二次 101/10/01		第三次 102/04/08		第四次 102/10/03		第五次 103/04/03		第六次 103/10/02		
		美金	原幣A	美金	原幣B	美金	原幣C	美金	原幣D	美金	原幣E	美金	原幣F	
農華富貴/ XS0341730363/ USD 967,000	967,000.00	3.6092%	3.6092%	2.4356%	2.4356%	3.0763%	3.0763%	3.6473%	3.6473%	3.9618%	3.9618%	2.9734%	2.9734%	19.7036%
12年CMS雙率區間/ XS0350635958/ UDS 6,190,000	6,306,509.55	3.6092%	3.6772%	2.4356%	2.4814%	3.0763%	3.1342%	3.6473%	3.7160%	3.9618%	4.0364%	2.9734%	3.0293%	20.0745%
12年雙星得利/ XS0361383192/ USD 1,060,000	1,071,660.00	3.6092%	3.6489%	2.4356%	2.4624%	3.0763%	3.1102%	3.6473%	3.6874%	3.9618%	4.0054%	2.9734%	3.0061%	19.9204%
2年期澳幣區間按日計息/ XS0341031432/ AUD 4,000,000	3,269,641.62	3.6092%	2.8532%	2.4356%	1.9204%	3.0763%	2.4246%	3.6473%	3.1841%	3.9618%	3.2611%	2.9734%	2.7829%	16.4262%
4年期澳幣一起發/ XS0356420215/ AUD 2,782,000 (註)	2,252,561.84	3.6092%	3.7683%	2.4356%	2.5363%	3.0763%	3.2023%	3.6473%	4.2054%	3.9618%	4.3071%	2.9734%	3.6755%	21.6948%
2年期澳幣固定配息2/ XS0346508962/ AUD 4,360,000	3,552,611.14	3.6092%	2.8441%	2.4356%	1.9143%	3.0763%	2.4169%	3.6473%	3.1740%	3.9618%	3.2507%	2.9734%	2.7740%	16.3740%
2年期澳幣固定配息3/ XS0365300069 AUD 2,420,000	1,965,457.69	3.6092%	2.8349%	2.4356%	1.9081%	3.0763%	2.4091%	3.6473%	3.1637%	3.9618%	3.2402%	2.9734%	2.7650%	16.3209%

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)

第一次分配(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29.32/30.395)。

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)。

第五次分配(103/04/03)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=1.007澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價30.19/29.97)。

第六次分配(103/10/02)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=1.145澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價30.45/26.58)。

計算公式：

本檔債券可分配受償金額=承認債權金額×承認債權比例

本檔債券受償入帳金額=【(原申購信託金額/本行信託持有總金額)×本檔債券可分配受償金額】

(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。)

本檔債券實際受償金額=本檔債券受償入帳金額×匯率(美金/澳幣)

本檔債券實際已返還金額之分配比例=本檔債券實際受償金額/原申購信託金額

*以上受償金額可能因小數點進位而有些差異。

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	本行信託 持有總金額 /全體投資人 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		第三次表示性分配比例 5.062% 103/04/28			
			承認債權依表示性 分配比例換匯後 可分配金額 (原幣)	原幣H	承認債權依表示性 分配比例換匯後 可分配金額 (原幣)	40.9798	承認債權依表示性 分配比例換匯後 可分配金額 (原幣)	原幣J		
農華富貴 /XS0341730363	USD967,000 /USD1,000,000	EUR721,560.31	USD 115,157.07	11.5157%	USD 46,864.17	4.6864%	USD 49,066.67	5.0741%	21.2762%	40.9798%
12年CMS雙率區間 /XS0350635958	USD6,190,000 /USD6,220,000	EUR4,662,883.19	USD 744,170.60	11.9642%	USD 302,846.67	4.8689%	USD 326,318.96	5.2717%	22.1048%	42.1793%
12年雙星得利 /XS0361383192	USD1,060,000 /USD1,060,000	EUR806,677.05	USD 128,741.24	12.1454%	USD 52,392.36	4.9427%	USD 56,726.66	5.3515%	22.4396%	42.3600%
2年期澳幣區間按日計息 /XS0341031432	AUD4,000,000 /AUD4,840,000	EUR2,780,780.13	AUD 427,358.91	8.8297%	AUD 186,811.72	3.8597%	AUD 172,490.02	4.3122%	17.0017%	33.4279%
4年期澳幣一起發 /XS0356420215	AUD2,782,000 /AUD2,782,000	EUR1,268,040.19	AUD 194,876.35	9.3399%	AUD 85,186.44	4.0827%	AUD 95,173.42	4.5613%	17.9839%	39.6788%
2年期澳幣固定配息2 /XS0346508962	AUD4,360,000 /AUD4,420,000	EUR2,454,855.02	AUD 391,254.89	8.8519%	AUD 171,029.54	3.8694%	AUD 188,486.64	4.3230%	17.0444%	33.4185%
2年期澳幣固定配息3 /XS0365300069	AUD2,420,000 /AUD2,420,000	EUR1,389,265.54	AUD 213,506.63	8.8226%	AUD 93,330.31	3.8566%	AUD 104,272.06	4.3087%	16.9879%	33.3089%

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)

第一次分配(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)。

第三次分配(103/04/28)：表示性分配比例係依可分配現金以2014.04.14每1美元=0.7198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=1.3893澳幣)。

計算公式：

本檔債券受償入帳(實際)金額 = 【承認債權依表示性分配比例換匯後可分配金額 × (本行信託持有總金額/全體投資人持有總金額) × (原申購信託金額/本行信託持有總金額)】

(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。)

本檔債券實際已返還金額之分配比例 = 本檔債券實際受償金額/原申購信託金額

*以上受償金額可能因小數點進位而有些差異。