

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C A+B
			第一次-第六次		第七次 104/04/02		
			美金	原幣A	美金	原幣B	
農華富貴/ XS0341730363	USD 967,000.00	967,000.00	19.7036%	19.7036%	2.0291%	2.0291%	21.7328%
12年CMS雙率區間/ XS0350635958	UDS 6,190,000.00	6,306,509.55	19.7036%	20.0745%	2.0291%	2.0673%	22.1418%
12年雙星得利/ XS0361383192	USD 1,060,000.00	1,071,660.00	19.7036%	19.9204%	2.0291%	2.0515%	21.9718%
2年期澳幣區間按日計息/ XS0341031432	AUD 4,000,000.00	3,269,641.62	19.7036%	16.4262%	2.0291%	2.1529%	18.5791%
4年期澳幣一起發/ XS0356420215	(註) AUD 2,782,000.00	2,252,561.84	19.7036%	21.6948%	2.0291%	2.8435%	24.5383%
2年期澳幣固定配息2/ XS0346508962	AUD 4,360,000.00	3,552,611.14	19.7036%	16.3740%	2.0291%	2.1461%	18.5201%
2年期澳幣固定配息3/ XS0365300069	AUD 2,420,000.00	1,965,457.69	19.7036%	16.3209%	2.0291%	2.1391%	18.4600%

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)。
- 第七次分配(104/04/02)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=1.298澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價31.085/23.94)。

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	申購 原幣	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&荷蘭)
				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		第四次表示性分配比例 4.248% 103/10/28			
				承認債權 依表示性 分配比例 換匯後可 分配金額 (原幣)	原幣D	承認債權 依表示性 分配比例 換匯後可 分配金額 (原幣)	原幣E	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	美元	967,000 /1,000,000	721,560.31	USD 115,157.07	11.5157%	USD 46,864.17	4.6864%	USD 49,066.67	5.0741%	USD 37,579.10	3.8862%	25.1624%	46.8952%
12年CMS雙率區間 /XS0350635958	美元	6,190,000 /6,220,000	4,662,883.19	USD 744,170.60	11.9642%	USD 302,846.67	4.8689%	USD 326,318.96	5.2717%	USD 249,920.57	4.0375%	26.1423%	48.2840%
12年雙星得利 /XS0361383192	美元	1,060,000 /1,060,000	806,677.05	USD 128,741.24	12.1454%	USD 52,392.36	4.9427%	USD 56,726.66	5.3515%	USD 43,445.71	4.0987%	26.5382%	48.5100%
2年期澳幣區間按日計息 /XS0341031432	澳幣	4,000,000 /4,840,000	2,780,780.13	AUD 427,358.91	8.8297%	AUD 186,811.72	3.8597%	AUD 172,490.02	4.3122%	AUD 140,859.90	3.5215%	20.5232%	39.1023%
4年期澳幣一起發 /XS0356420215 (註)	澳幣	2,782,000 /2,782,000	1,268,040.19	AUD 194,876.35	9.3399%	AUD 85,186.44	4.0827%	AUD 95,173.42	4.5613%	AUD 77,721.13	3.7250%	21.7089%	46.2472%
2年期澳幣固定配息2 /XS0346508962	澳幣	4,360,000 /4,420,000	2,454,855.02	AUD 391,254.89	8.8519%	AUD 171,029.54	3.8694%	AUD 188,486.64	4.3230%	AUD 153,923.16	3.5303%	20.5747%	39.0949%
2年期澳幣固定配息3 /XS0365300069	澳幣	2,420,000 /2,420,000	1,389,265.54	AUD 213,506.63	8.8226%	AUD 93,330.31	3.8566%	AUD 104,272.06	4.3087%	AUD 85,151.31	3.5186%	20.5066%	38.9666%

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歐言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歐言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歐言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)。

第四次分配(103/10/28)：表示性分配比例係依可分配現金以2014.10.13每1美元=0.7888歐言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=1.13804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額。