

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-第七次		第八次 104/10/01		
			美金	原幣A	美金	原幣B	
農華富貴/ XS0341730363	USD 967,000.00	967,000.00	21.7327%	21.7327%	1.5476%	1.5477%	23.2804%
12年CMS雙率區間/ XS0350635958	UDS 6,190,000.00	6,306,509.55	21.7327%	22.1418%	1.5476%	1.5768%	23.7186%
12年雙星得利/ XS0361383192	USD 1,060,000.00	1,071,660.00	21.7327%	21.9719%	1.5476%	1.5646%	23.5365%
2年期澳幣區間按日計息/ XS0341031432	AUD 4,000,000.00	3,269,641.62	21.7327%	18.5791%	1.5476%	1.7951%	20.3742%
4年期澳幣一起發/ XS0356420215	(註) AUD 2,782,000.00	2,252,561.84	21.7327%	24.5383%	1.5476%	2.3709%	26.9092%
2年期澳幣固定配息2/ XS0346508962	AUD 4,360,000.00	3,552,611.14	21.7327%	18.5202%	1.5476%	1.7894%	20.3096%
2年期澳幣固定配息3/ XS0365300069	AUD 2,420,000.00	1,965,457.69	21.7327%	18.4601%	1.5476%	1.7836%	20.2437%

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)。

第八次分配(104/10/01)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=1.419澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價32.71/23.05)。

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 (原幣)	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)							
					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	115,157.07	11.5157%	46,864.17	4.6864%	49,066.67	5.0741%	37,579.10	3.8862%
12年CMS雙率區間 /XS0350635958	美元	6,190,000	6,220,000	4,662,883.19	744,170.60	11.9642%	302,846.67	4.8689%	326,318.96	5.2717%	249,920.57	4.0375%
12年雙星得利 /XS0361383192	美元	1,060,000	1,060,000	806,677.05	128,741.24	12.1454%	52,392.36	4.9427%	56,726.66	5.3515%	43,445.71	4.0987%
2年期澳幣區間按日計息 /XS0341031432	澳幣	4,000,000	4,840,000	2,780,780.13	427,358.91	8.8297%	186,811.72	3.8597%	172,490.02	4.3122%	140,859.90	3.5215%
4年期澳幣一起發 /XS0356420215 (註)	澳幣	2,782,000	2,782,000	1,268,040.19	194,876.35	9.3399%	85,186.44	4.0827%	95,173.42	4.5613%	77,721.13	3.7250%
2年期澳幣固定配息2 /XS0346508962	澳幣	4,360,000	4,420,000	2,454,855.02	391,254.89	8.8519%	171,029.54	3.8694%	188,486.64	4.3230%	153,923.16	3.5303%
2年期澳幣固定配息3 /XS0365300069	澳幣	2,420,000	2,420,000	1,389,265.54	213,506.63	8.8226%	93,330.31	3.8566%	104,272.06	4.3087%	85,151.31	3.5186%

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 (原幣)	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)	
					第五次表示性分配比例 3.41% 104/04/27		第六次表示性分配比例 2.44% 104/10/29			
					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)			原幣I
農華富貴 /XS0341730363	美元	967,000	1,000,000	721,560.31	25,303.24	2.6166%	19,461.17	2.0125%	29.7915%	53.0720%
12年CMS雙率區間 /XS0350635958	美元	6,190,000	6,220,000	4,662,883.19	168,279.72	2.7185%	129,426.95	2.0909%	30.9517%	54.6703%
12年雙星得利 /XS0361383192	美元	1,060,000	1,060,000	806,677.05	29,253.42	2.7597%	22,499.33	2.1225%	31.4206%	54.9571%
2年期澳幣區間按日計息 /XS0341031432	澳幣	4,000,000	4,840,000	2,780,780.13	107,611.64	2.6903%	88,805.72	2.2201%	25.4336%	45.8079%
4年期澳幣一起發 /XS0356420215 (註)	澳幣	2,782,000	2,782,000	1,268,040.19	59,376.01	2.8457%	48,999.62	2.3483%	26.9030%	53.8123%
2年期澳幣固定配息2 /XS0346508962	澳幣	4,360,000	4,420,000	2,454,855.02	117,591.49	2.6970%	97,041.52	2.2257%	25.4975%	45.8071%
2年期澳幣固定配息3 /XS0365300069	澳幣	2,420,000	2,420,000	1,389,265.54	65,052.39	2.6881%	53,684.01	2.2183%	25.4130%	45.6567%

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。

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)。

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=1.13804 澳幣)。

第五次分配(104/04/27)：表示性分配比例係依可分配現金以2015.04.13每1美元=0.9457 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=1.29122 澳幣)。

第六次分配(104/10/29)：表示性分配比例係依可分配現金以2015.10.14每1美元=0.8748 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=1.38545 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。