

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-第十次		第十一次 105/10/06		
			美金	原幣A	美金	原幣B	
農華富貴/ XS0341730363	USD 967,000.00	967,000.00	24.3492%	24.3494%	1.1243%	1.1244%	25.4738%
12年CMS變率區間/ XS0350635958	UDS 6,190,000.00	6,306,509.55	24.3492%	24.8077%	1.1243%	1.1456%	25.9533%
12年雙星得利/ XS0361383192	USD 1,060,000.00	1,071,660.00	24.3492%	24.6173%	1.1243%	1.1367%	25.7540%
2年期澳幣區間按日計息/ XS0341031432	AUD 4,000,000.00	3,269,641.62	24.3492%	21.5445%	1.1243%	1.2123%	22.7568%
4年期澳幣一起發/ XS0356420215	(註) AUD 2,782,000.00	2,252,561.84	24.3492%	28.4550%	1.1243%	1.6011%	30.0561%
2年期澳幣固定配息2/ XS0346508962	AUD 4,360,000.00	3,552,611.14	24.3492%	21.4763%	1.1243%	1.2084%	22.6847%
2年期澳幣固定配息3/ XS0365300069	AUD 2,420,000.00	1,965,457.69	24.3492%	21.4066%	1.1243%	1.2045%	22.6111%

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)。
- 第九次分配(105/03/31)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=1.3085澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價32.185/24.595)。
- 第十次分配(105/06/16)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=1.3602澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價32.38/23.805)。
- 第十一次分配(105/10/06)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=1.3190澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價31.40/23.805)。

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)				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~第七次		第八次表示性分配比例 1.03% 105/07/14			
					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		
農華富貴 /XS0341730363	美元	967,000	1,000,000	721,560.31	293,431.42	30.3537%	7,954.15	0.8225%	31.1762%	56.6500%
12年CMS雙率區間 /XS0350635958	美元	6,190,000	6,220,000	4,662,883.19	1,920,963.47	31.5358%	52,899.20	0.8546%	32.3904%	58.3437%
12年雙星得利 /XS0361383192	美元	1,060,000	1,060,000	806,677.05	333,058.72	32.0134%	9,195.90	0.8675%	32.8809%	58.6349%
2年期澳幣區間按日計息 /XS0341031432	澳幣	4,000,000	4,840,000	2,780,780.13	1,123,937.91	26.0067%	34,945.25	0.8736%	26.8803%	49.6371%
4年期澳幣一起發 /XS0356420215 (註)	澳幣	2,782,000	2,782,000	1,268,040.19	561,332.97	27.5091%	19,281.46	0.9241%	28.4332%	58.4893%
2年期澳幣固定配息2 /XS0346508962	澳幣	4,360,000	4,420,000	2,454,855.02	1,119,327.24	26.0719%	38,186.04	0.8758%	26.9477%	49.6324%
2年期澳幣固定配息3 /XS0365300069	澳幣	2,420,000	2,420,000	1,389,265.54	614,996.71	25.9856%	21,124.77	0.8729%	26.8585%	49.4696%

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)。

第七次分配(105/04/28)：表示性分配比例係依可分配現金以2016.04.13每1美元=0.8848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=1.28014澳幣)。

第八次分配(105/07/14)：表示性分配比例係依可分配現金以2016.06.29每1美元=0.90457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=1.33387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。