

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-第十二次		第十三次 106/10/05		
			美金	原幣A	美金	原幣B	
農華富貴/ XS0341730363	USD 967,000.00	967,000.00	26.3298%	26.3302%	0.5478%	0.5478%	26.8780%
12年CMS變率區間/ XS0350635958	UDS 6,190,000.00	6,306,509.55	26.3298%	26.8258%	0.5478%	0.5582%	27.3840%
12年雙星得利/ XS0361383192	USD 1,060,000.00	1,071,660.00	26.3298%	26.6198%	0.5478%	0.5539%	27.1737%
2年期澳幣區間按日計息/ XS0341031432	AUD 4,000,000.00	3,269,641.62	26.3298%	23.6849%	0.5478%	0.5723%	24.2572%
4年期澳幣一起發/ XS0356420215	(註) AUD 2,782,000.00	2,252,561.84	26.3298%	31.2818%	0.5478%	0.7558%	32.0376%
2年期澳幣固定配息2/ XS0346508962	AUD 4,360,000.00	3,552,611.14	26.3298%	23.6098%	0.5478%	0.5705%	24.1803%
2年期澳幣固定配息3/ XS0365300069	AUD 2,420,000.00	1,965,457.69	26.3298%	23.5332%	0.5478%	0.5686%	24.1018%

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)。
- 第十二次分配(106/04/06)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=1.3258澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價30.555/23.045)。
- 第十三次分配(106/10/05)：分配金額換算澳幣信託本金為1美元=1.2779澳幣(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價30.32/23.725)。

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~第十次		第十一次表示性分配比例 0.83% 106/10/23			
					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	331,522.34	33.7305%	6,819.66	0.70524%	34.4357%	61.3137%
12年CMS雙率區間 /XS0350635958	美元	6,190,000	6,220,000	4,662,883.19	2,174,287.90	35.0441%	45,354.31	0.73270%	35.7768%	63.1608%
12年雙星得利 /XS0361383192	美元	1,060,000	1,060,000	806,677.05	377,096.16	35.5749%	7,884.31	0.74380%	36.3187%	63.4924%
2年期澳幣區間按日計息 /XS0341031432	澳幣	4,000,000	4,840,000	2,780,780.13	1,291,110.94	29.6129%	28,462.74	0.71157%	30.3244%	54.5816%
4年期澳幣一起發 /XS0356420215(註)	澳幣	2,782,000	2,782,000	1,268,040.19	653,572.69	31.3236%	15,704.66	0.75268%	32.0763%	64.1139%
2年期澳幣固定配息2 /XS0346508962	澳幣	4,360,000	4,420,000	2,454,855.02	1,302,003.78	29.6871%	31,102.36	0.71336%	30.4004%	54.5807%
2年期澳幣固定配息3 /XS0365300069	澳幣	2,420,000	2,420,000	1,389,265.54	716,054.59	29.5888%	17,206.03	0.71099%	30.2998%	54.4016%

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)。

第九次分配(105/11/29)：表示性分配比例係依可分配現金以2016.11.11每1美元=0.92100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=1.35677澳幣)。

第十次分配(106/05/04)：表示性分配比例係依可分配現金以2017.04.10每1美元=0.94318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=1.06024澳幣)。

第十一次分配(106/10/23)：表示性分配比例係依可分配現金以2017.10.09每1美元=0.8499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=1.26716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。