

附表一：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/<br>ISIN Number<br>國際證券編碼 | 申購<br>原幣 | 本行信託<br>持有總金額<br>(原幣) | 全體投資人<br>持有總金額<br>(原幣) | 荷蘭雷曼<br>財務公司<br>承認債權<br>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)<br>第一次~第十五次表示性分配比例 |          |
|--------------------------------|----------|-----------------------|------------------------|--------------------------------|---------------------------------------------|----------|
|                                |          |                       |                        |                                | 承認債權<br>依表示性分配比例<br>換匯後可分配金額<br>(原幣)        | 原幣D      |
| 農華富貴<br>/XS0341730363          | 美元       | 967,000               | 1,000,000              | 721,560.31                     | 369,848.6                                   | 38.2470% |
| 12年CMS雙率區間<br>/XS0350635958    | 美元       | 6,190,000             | 6,220,000              | 4,662,883.19                   | 2,459,686.22                                | 39.7365% |
| 12年雙星得利<br>/XS0361383192       | 美元       | 1,060,000             | 1,060,000              | 806,677.05                     | 427,587.12                                  | 40.3384% |
| 2年期澳幣區間按日計息<br>/XS0341031432   | 澳幣       | 4,000,000             | 4,840,000              | 2,780,780.13                   | 1,378,432.74                                | 34.4608% |
| 4年期澳幣一起發<br>/XS0356420215 (註)  | 澳幣       | 2,782,000             | 2,782,000              | 1,268,040.19                   | 760,566.72                                  | 36.4518% |
| 2年期澳幣固定配息2<br>/XS0346508962    | 澳幣       | 4,360,000             | 4,420,000              | 2,454,855.02                   | 1,506,267.77                                | 34.5474% |
| 2年期澳幣固定配息3<br>/XS0365300069    | 澳幣       | 2,420,000             | 2,420,000              | 1,389,265.54                   | 833,277.31                                  | 34.4329% |

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)

表示性分配比例係依歷次可分配現金，並以雷曼債務人之破產計畫管理人所公布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，歷次分配金額轉換匯率請詳本行官網「雷曼兄弟集團連動債券事件說明及問答集」專區之歷次訊息通知函。

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)】

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(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/<br>ISIN Number<br>國際證券編碼 | 申購<br>原幣 | 本行信託<br>持有總金額<br>(原幣) | 美國雷曼<br>控股公司<br>承認債權<br>金額(美金) | 美國雷曼控股公司受償分配比例<br>承認債權比例(美金)/實際債權比例(原幣) |          |                   |         | 美國雷曼控股公司<br>累計實際受償<br>債權分配比例 | 雷曼債務人<br>累計實際受償分配比例<br>(美國&荷蘭) |
|--------------------------------|----------|-----------------------|--------------------------------|-----------------------------------------|----------|-------------------|---------|------------------------------|--------------------------------|
|                                |          |                       |                                | 第一次-第二十九次                               |          | 第三十次<br>114/04/03 |         |                              |                                |
|                                |          |                       |                                | 美金                                      | 原幣A      | 美金                | 原幣B     | 原幣C<br>A+B                   | 原幣E<br>C+D                     |
| 農華富貴<br>/XS0341730363          | 美元       | 967,000               | 967,000.00                     | 29.3609%                                | 29.3609% | 0.0437%           | 0.0437% | 29.4046%                     | 67.6516%                       |
| 12年CMS雙率區間<br>/XS0350635958    | 美元       | 6,190,000             | 6,306,509.55                   | 29.3609%                                | 29.9135% | 0.0437%           | 0.0445% | 29.9580%                     | 69.6944%                       |
| 12年雙星得利<br>/XS0361383192       | 美元       | 1,060,000             | 1,071,660.00                   | 29.3609%                                | 29.6838% | 0.0437%           | 0.0442% | 29.7280%                     | 70.0664%                       |
| 2年期澳幣區間按日計息<br>/XS0341031432   | 澳幣       | 4,000,000             | 3,269,641.62                   | 29.3609%                                | 27.0494% | 0.0437%           | 0.0595% | 27.1089%                     | 61.5697%                       |
| 4年期澳幣一起發<br>/XS0356420215 (註)  | 澳幣       | 2,782,000             | 2,252,561.84                   | 29.3609%                                | 35.7254% | 0.0437%           | 0.0786% | 35.8040%                     | 72.2557%                       |
| 2年期澳幣固定配息2<br>/XS0346508962    | 澳幣       | 4,360,000             | 3,552,611.14                   | 29.3609%                                | 26.9636% | 0.0437%           | 0.0593% | 27.0229%                     | 61.5703%                       |
| 2年期澳幣固定配息3<br>/XS0365300069    | 澳幣       | 2,420,000             | 1,965,457.69                   | 29.3609%                                | 26.8760% | 0.0437%           | 0.0591% | 26.9352%                     | 61.3681%                       |

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)

第三十次分配(114/04/03)：分配金額換算澳幣信託本金為 1 美元=1.6658 澳幣

(即分配當日台灣銀行匯率收盤中價 33.05/19.84)。

【本函僅揭露最新一次分配金額換算匯率，歷次分配金額換算匯率請詳本行官網「雷曼兄弟集團連動債券事件說明及問答集」專區之歷次訊息通知函。】

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。