

『雙星步步高 47 十年美金利率型』組合式商品成交條件

親愛的客戶 您好：

感謝您參與本公司推出之「雙星步步高 47 十年美金利率型」組合式商品，本公司已為您作好投資商品之登錄，以下是本商品於交易日時，相關條件確立之內容：

交易日	2011 年 12 月 09 日	起息日	2011 年 12 月 13 日
到期日	2021 年 12 月 13 日，另將受限於營業日慣例及發行機構提前到期。		
商品計價幣別	美金	發行價格	100%
商品面額	美金 10,000 元		
到期本金保本率	於未發生提前終止之情形，且到期時發行機構未發生違約情事，到期結算稅前金額為 100% (稅前)美金 ，或其等值。		
發行機構	台北富邦商業銀行股份有限公司		
計算代理機構	台北富邦商業銀行股份有限公司		
投資收益給付及其計算方式：			
配息率	年息 4.16% × (應計日數 / 實際日數)		
應計日數	於該配息計算期間內，觀察指標(連結標的)定價落於計息區間內之日曆天數。		
實際日數	該配息計算期間內之總日曆天數		
計息區間	期間	計息下界(含)	計息上界(含)
	第一年~第三年	0%	4.00%
	第四年~第七年	0%	4.50%
	第八年~第十年	0%	5.25%
觀察指標 1(連結標的 1)	美金 10 年期固定期限交換利率		
觀察指標 1(連結標的 1)定價	<ul style="list-style-type: none"> ● 就任一美國政府證券營業日而言，觀察指標 1 定價為當日於路透社 ISDAFIX1 頁面(紐約時間早上 11:00)所觀察到的美金 10 年期固定期限交換利率定價。 ● 就非美國政府證券營業日而言，該日之觀察指標 1 定價將依前一個美國政府證券營業日之觀察指標 1 定價為準。 ● 就每個配息計算期間的最後四個美國政府證券營業日而言，觀察指標 1 定價將不被觀察，而直接視為與該配息計算期間倒數第五個美國政府證券營業日之觀察指標 1 定價相同。 ● 在其他情況下，計算代理機構將獨立自行決定觀察指標 1 定價。 		
觀察指標 2(連結標的 2)	美金 2 年期固定期限交換利率		

觀察指標 2(連結標的 2)定價	<ul style="list-style-type: none"> ● 就任一美國政府證券營業日而言，觀察指標 2 定價為當日於路透社 ISDAFIX1 頁面(紐約時間早上 11:00)所觀察到的美金 2 年期固定期限交換利率定價。 ● 就非美國政府證券營業日而言，該日之觀察指標 2 定價將依前一個美國政府證券營業日之觀察指標 2 定價為準。 ● 就每個配息計算期間的最後四個美國政府證券營業日而言，觀察指標 2 定價將不被觀察，而直接視為與該配息計算期間倒數第五個美國政府證券營業日之觀察指標 2 定價相同。 ● 在其他情況下，計算代理機構將獨立自行決定觀察指標 2 定價。 		
配息日	每季，自 2012 年 03 月 13 日 起(含)之每年的 03 月 13 日、06 月 13 日、09 月 13 日、12 月 13 日 至到期日止。如該日非營業日，則依營業日慣例調整。		
配息計算期間	每個配息計算期間，係自前一個配息日起(含)(第一期自起息日開始)至當期之配息日止(不含)。就以計算應計配息的目的而言，這些日期並不會因為營業日慣例而有所調整。		
計息基礎	每季，30/360		
發行機構 提前到期	自 2012 年 03 月 13 日 起的每一個配息日，發行機構有權於該配息日以稅前 100% 美金 本金贖回本商品。		
營業日慣例	修正順延制 (Modified Following)	交割營業日	紐約、倫敦、台北
商品提前終止 (次級市場)	<p>本商品非流動性佳之投資工具，投資人應持有本商品至到期。發行機構無義務且不保證本商品次級市場的持續存在與流通性，發行機構可以隨時終止次級市場交易。</p> <p>在正常的市場狀況下（依發行機構之判斷），自起息日起三個月(閉鎖期滿)後，發行機構將於每月10日提供次級市場交易。不得部分解約。次級市場交易價格由發行機構依其善意決定，該價格可能低於面額。交易價格將取決於但不限以下因素：利率水平，利率波動度，發行機構之信用品質，距離到期年限。</p> <p>次級市場交易指示可能因為市場因素而無法成交，尤其在流動性缺乏或交易量不足的情況下，商品之實際交易價格可能會與其參考報價產生顯著之價差。因此，投資人若於商品到期前申請提前終止(或稱解約)，必須以申請解約當時之實際交易價格成交，並可能會發生損及原始投資金額的狀況，甚至一旦在市場完全喪失流動性的情況下，投資人仍必須持有本商品至到期日。提前終止結算金額（應由投資人負擔之相關費用、損失、違約金及預付稅款得由本行自本金及稅前收益金額中先行代扣）則轉入投資人指定之活期存款帳戶(倘有)。</p>		

商品其他相關條件，悉同申購時所簽立之商品說明書，如有疑問，請洽詢你的理財專員/專屬金融服務人員。

順頌 安祈

台北富邦銀行 敬啟