

SN01境外結構型商品配息狀況

商品代號	商品名稱	發行機構	風險等級	商品天期	幣別	連結標的	連結標的區間	(季)配息率
SN01	英商摩根士丹利發行15年期美元計價雙標的區間計息發行機構可買回結構型商品(無保證機構)(無擔保)	摩根士丹利MSIP	積極型	15年	美元	1. EURUSD Curncy 2. SPX index	$1.00 \leq \text{EURUSD} \leq 1.35$ 且 $3500 \leq \text{SPX} \leq 5250$	Y1: 7.00% $\times 90/360$ Y2-Y15: 5.80% $\times (90/360) \times n(j)/N(j)$

ISIN:XS2326250409

配息次數	觀察期間		實際付款日	季配息率
1	2021/09/03	2021/11/26	2021/12/06	1.7500%
2	2021/11/29	2022/02/23	2022/03/04	1.7500%
3	2022/02/24	2022/05/25	2022/06/07	1.7500%
4	2022/05/26	2022/08/26	2022/09/07	1.7500%
5	2022/08/29	2022/11/28	2022/12/06	0.4984%
6	2022/11/29	2023/02/22	2023/03/06	1.4500%
7	2023/02/23	2023/05/26	2023/06/06	1.4500%
8	2023/05/30	2023/08/25	2023/09/06	1.4500%
9	2023/08/28	2023/11/27	2023/12/05	1.4500%
10	2023/11/28	2024/02/23	2024/03/05	1.4500%
11	2024/02/26	2024/05/24	2024/06/04	1.2461%
12	2024/05/28	2024/08/23	2024/09/04	0.0935%
13	2024/08/26	2024/11/25	不配息	0.0000%
14	2024/11/26	2025/02/21	不配息	0.0000%

連結標的資產:

連結標的	彭博代碼(Bloomberg)
1. 歐元兌美元即期匯率(EUR/USD Spot)	EURUSD Curncy
2. 標準普爾500指數 (Standard and Poor' s 500 Index)	SPX Index

備註:一、總代理人公告之配息事項揭露於「境外結構型商品資訊觀測站」,網址為<https://structurednotes.tdcc.com.tw>。

二、本商品SN01之配息頻率為每季,總配息次數60次,目前配息次數第14次。

三、連結標的資產:(i) 連結標的1: 歐元兌美元即期匯率(EUR/USD Spot);(ii) 連結標的2: 標準普爾500指數 (Standard and Poor' s 500 Index)

四、觀察期間:從一個觀察期間起始日(含)至該觀察期間結束日(含)。

五、配息期間:每個觀察期間。

六、觀察日:任一結算匯率評價日,且同時為指數評價日。簡言之,任一連結標的的非評價日將不被視為一個觀察日,不予計入 $n(j)$ 與 $N(j)$ 之天數計算。

七、季配息率:

(一) 第一年(第1個至第4個配息期間)固定配息: $7.00\% \times (90/360)$

(二) 第二年至第十五年(第5個至第60個配息期間): $5.80\% \times (90/360) \times n(j)/N(j)$

其中:

$n(j)$ = 於第 j 個觀察期間,連結標的 1 匯率水準等於或大於匯率配息下限及等於或小於匯率配息上限,

且連結標的 2 指數收盤價等於或大於指數配息下限及等於或小於指數配息上限。

$N(j)$ = 於第 j 個觀察期間的觀察日總數。

連結標的1區間: 1.00至1.35 (含上下限); 連結標的2區間: 3,500至5,250 (含上下限)。

連結標的1之匯率水準=就連結標的1而言,於倫敦時間當日下午 4點整公告顯示於Bloomberg "EURUSD L160 Curncy" 頁面之歐元兌美元即期匯率。

連結標的2之指數收盤價=就連結標的2之股票指數交易日而言,在相關觀察期間每一指數預定交易日公告顯示於Bloomberg "SPX Index" 頁面之指數正式收盤價。