

【投資起始日】2005/4/28

【年期】10年期

【評價日】

轉換事件發生前

2007/4/16、2008/4/14、2009/4/14、2010/4/14、2011/4/12、2012/4/16、2013/4/15、2014/4/10、2015/4/14

轉換事件發生後

2007/4/26、2008/4/24、2009/4/24、2010/4/26、2011/4/26、2012/4/26、2013/4/25、2014/4/24

【到期贖回價格】100%投資本金

【投資本金計價幣別】美元

【行政管理費用率】3.5%

【保管銀行】中央信託局股份有限公司

【債券評等】Moody's Investor Service：長期債券評等 Aa3

【投資收益計算公式】

投資收益_t = 投資本金 × R_t

$$R_t = \begin{cases} 8\% & \text{,第1年} \\ \text{取最大值}(10.4 \times (30Y \text{ USD CMS} - 10Y \text{ USD CMS}), 0\%) & \text{,第2年起,轉換事件發生前} \\ 12.5\% - \text{累積至前一年之投資收益率} & \text{,轉換事件發生時之年度} \\ 12M \text{ USD LIBOR} & \text{,轉換事件發生後之次一年度} \\ 12.5\% - \text{累積至前一年之投資收益率} & \text{,第10年,若轉換事件未曾發生} \end{cases}$$

自投資起始日起，於每一年年末，當累積至前一年之投資收益率加上“取最大值(10.4 × (30Y USD CMS - 10Y USD CMS), 0%)”大於或等於12.5%時，該事件為**轉換事件**，該發生日稱為**轉換日**。

【發行/保證機構】

德意志銀行 (Deutsche Bank AG)

發行機構：德意志銀行 (Deutsche Bank AG)

保證機構：德意志銀行 (Deutsche Bank AG)

1. 德意志銀行為國際知名的金融集團，創立於西元1870年，為歐洲第一大銀行，亦為世界資產排名第四大之銀行。
2. 2002年1月歐元雜誌 (Euromoney) 針對所有銀行客戶的調查中，德意志銀行再度獲選為「世界最佳銀行」。
- 2001年9月之銀行家雜誌 (The Banker) 並推選德意志銀行為「世界最佳衍生性商品銀行」。
3. 德意志銀行在世界70餘國設有超過2000家分行，全體員工超過7萬人，全世界超過1300萬的客戶。
4. 2003年6月的資產總額為8,512億歐元。

【信用評等】

1. Moody's Investor Service：長期債券評等 Aa3
2. Standard & Poor's Rating Group：長期債券評等 AA-

【連結標的】

- ◆ 30Year USD Constant Maturity Swap Rate
(30Y USD CMS, 30 年期美元固定到期日利率交換利率)
- ◆ 10Year USD Constant Maturity Swap Rate
(10Y USD CMS, 10 年期美元固定到期日利率交換利率)
- ◆ 12Month USD London Inter-Bank Offering Rate
(12M USD LIBOR, 倫敦銀行間 12 月期美元同業拆款利率)