

境外結構型商品連結標的變更通知

由於英國金融行為監理局(FCA)已公布 LIBOR 將於 2023 年 06 月 30 日後退場，相關商品將失效(包含本商品連結標的一併失效)。發行機構 SG ISSUER 提出連結標的替代方案，與美國聯邦儲備理事會及紐約聯邦儲備銀行召開替代參考利率委員會 (ARRC) 之會議推薦之方法相同，並經國際交換暨衍生性商品協會採用，美元固定期限交換利率之替代利率計算如下：

$$\frac{365.25}{360} * \left[2 * (\sqrt{1 + SOFR SR} - 1) + ISDA Spread (3m LIBOR) * \frac{1}{2} * (\sqrt{1 + SOFR SR} + 1) \right]$$

「SOFR SR」係指美元SOFR ICE交換利率；

「ISDA Spread (3m LIBOR)」為0.26161%。

受影響之相關境外結構型商品代碼及名稱

商品代碼	境外結構型商品名稱
SNSG1807	SG ISSUER 12 年期南非幣計價發行機構可買回利率利差連結結構型商品(無擔保)
SNSG1903	SG ISSUER 8 年期南非幣計價(發行機構可買回)連結利率每日計息結構型商品(無擔保)
SNSG2001	SG ISSUER 8 年期境外人民幣計價(發行機構可買回)連結利率每日計息結構型商品(無擔保)

謹以此通知提醒 您投資商品的重要訊息，如有任何參考贖回價或其他問題，可至本行網站 <https://www.tcbank.com.tw/> 查詢，或歡迎洽詢您的理財業務人員，也希望您繼續支持本行，謝謝。

敬頌 時祺

台中銀行敬上
2023年05月