

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 Crédit Agricole CIB Financial Solutions 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：

Fallback USD LIBOR ISR

$$= \frac{365.25}{360} * \left[2 * (\sqrt{1 + SOFR ISR} - 1) + ISDA Spread (3m LIBOR) * \frac{1}{2} * (\sqrt[4]{1 + SOFR ISR} + 1) \right]$$

「Fallback USD LIBOR ISR」係指計算得出且到期期間為指定到期期間之美元ISR替代利率；

「SOFR ISR」係指美元SOFR ICE交換利率；

「ISDA Spread (3m LIBOR)」為0.26161%。

受影響之相關結構型商品代碼及名稱

商品代碼	結構型商品名稱
SNCA1804	Crédit Agricole CIB Financial Solutions 十二年期可提前買回(發行機構前六個月不可買回)南非幣計價連結利率結構型商品(無擔保)
SNCA1807	Crédit Agricole CIB Financial Solutions 十五年期可提前買回(發行機構前六個月不可買回)美元計價連結利率結構型商品(無擔保)
SNCA2103	Crédit Agricole CIB Financial Solutions 五年期可提前買回(發行機構前六個月不可買回)南非幣計價區間每日計息連結利率結構型商品(無擔保)
SNCA2104	Crédit Agricole CIB Financial Solutions 五年期可提前買回(發行機構前六個月不可買回)南非幣計價區間每日計息連結利率結構型商品(無擔保)
SNCA2105	Crédit Agricole CIB Financial Solutions 五年期可提前買回(發行機構前六個月不可買回)南非幣計價區間每日計息連結利率結構型商品(無擔保)
SNCA2106	Crédit Agricole CIB Financial Solutions 十年期可提前買回(發行機構前六個月不可買回)南非幣計價區間每日計息連結利率結構型商品(無擔保)
SNCA2107	Crédit Agricole CIB Financial Solutions 八年期可提前買回(發行機構前六個月不可買回)南非幣計價區間每日計息連結利率結構型商品(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