

投資型保單連結境外結構型商品信用風險預警表

製表日: 2012/5/21

警示標準 1

警示標準 2

Fund Code	結構型債券名稱	幣別	ISIN code	到期日	面額 (原幣)	淨值(原幣) (2012/5/17)	已配息率 (原幣)	報酬% (含已配息)	發行機構	保證機構	Fitch	Moody's	S&P	5Y CDS (2012/5/18)	警示 狀況
FS01	食時有利六年期美元結構型債券	USD	XS0338757031	2014/2/20	100%	94.31%	7.80%	2.11%	RBS N.V .RBS PLC	同發行機構	A	A2	A	341	正常
FS02	食時有利六年期澳幣結構型債券	AUD	XS0338756140	2014/2/20	100%	90.27%	17.75%	8.02%	RBS N.V .RBS PLC	同發行機構	A	A2	A	341	正常
FS03	女而紅六年期美元結構型債券	USD	XS0353751554	2014/3/17	100%	89.09%	7.00%	-3.91%	UBS AG/ London	同發行機構	A	Aa3	A	203	正常
FS04	女而紅六年期澳幣結構型債券	AUD	XS0353780652	2014/3/17	100%	88.74%	13.00%	1.74%	UBS AG/ London	同發行機構	A	Aa3	A	203	正常
FS07	新興向榮六年期澳幣結構型債券	AUD	XS0360103716	2014/5/6	100%	88.99%	10.00%	-1.01%	UBS AG/ London	同發行機構	A	Aa3	A	203	正常
FS10	美利恆生六年期美元結構型債券	USD	XS0364346865	2014/7/29	100%	108.70%	0.00%	8.70%	UBS AG/ London	同發行機構	A	Aa3	A	203	正常
FS11	商機無限六年期澳幣結構型債券	AUD	XS0365639821	2014/6/11	100%	132.32%	0.00%	32.32%	SGA Société Générale Acceptance N.V	Societe Generale SA	A+	A1	A	402	警示
FS13	高利升六年期美元結構型債券	USD	XS0441753802	2015/8/25	100%	108.86%	0.00%	8.86%	Barclays Bank PLC	同發行機構	A	Aa3	A+	237	正常
FS14	摩根大通 10 年期動態保本結構型債券	USD	XS0446532813	2019/8/27	100%	115.83%	0.00%	15.83%	J.P. Morgan Structured Products B.V.	JPMorgan Chase & Co.	A+	Aa3	A	154	正常

註:FS11及FS14信評及CDS為保證機構資料

警示標準:

- 1 每單位淨值未達面額的70%，並於之後每降幅達面額10%時。(投資標的需考慮配息，即需加回已分配之配息率)。
- 2 檢視發行或保證機構信用違約交換(CDS)達400bps，並於之後每增加50bps時。

若達上述任一條件時，「警示狀況」欄位以"警示"字眼提醒。