

# 全球人壽

備查文號：(96)全球壽(市產)字第 110201 號  
備查日期：96 年 11 月 2 日  
備查文號：(96)全球壽(市產)字第 123103 號  
備查日期：96 年 12 月 31 日  
備查文號：(97)全球壽(市產)字第 030704 號  
備查日期：97 年 3 月 7 日  
備查文號：(97)全球壽(市產)字第 053005 號  
備查日期：97 年 5 月 30 日  
備查文號：(97)全球壽(市產)字第 062004 號  
備查日期：97 年 6 月 20 日  
備查文號：(97)全球壽(市產)字第 080104 號  
備查日期：97 年 8 月 1 日  
備查文號：(97)全球壽(市產)字第 092205 號  
備查日期：97 年 9 月 22 日  
備查文號：(98)全球壽(市產)字第 041705 號  
備查日期：98 年 4 月 17 日  
備查文號：全球壽(商研)字第 0981030005 號  
備查日期：98 年 10 月 30 日

## 全球人壽富利變額萬能壽險 契約條款

給付項目：

身故保險金或喪葬費用保險金、完全殘廢保險金、  
一百一十一祝壽保險金

「本保險為不分紅保險單，不參加紅利分配，並無紅利給付項目。」

「本商品經本公司合格簽署人員檢視其內容業已符合一般精算原則及保險法令，惟為確保權益，基於保險公司與消費者衡平對等原則，消費者仍應詳加閱讀保險單條款與相關文件，審慎選擇保險商品。本商品如有虛偽不實或違法情事，應由本公司及負責人依法負責。」

「投保後解約或不繼續繳費可能不利消費者，請慎選符合需求之保險商品。」

「保險契約各項權利義務皆詳列於保單條款，消費者務必詳加閱讀了解，並把握保單契約撤銷之時效（收到保單翌日起算十日內）。」

（免費服務及申訴電話：0800-000-662）

### 第一條【保險契約的構成】

本保險單條款、附著之要保書、批註及其他約定書，均為本保險契約（以下簡稱本契約）的構成部分。本契約的解釋，應探求契約當事人的真意，不得拘泥於所用的文字；如有疑義時，以作有利於被保險人的解釋為原則。

### 第二條【名詞定義】

本契約所用之名詞，定義如下：

- 一、「基本保額」係指保單面頁所載之投保金額。要保人經本公司同意得變更該「基本保額」，若有任何變更則以變更後之「基本保額」為準。
- 二、「保險型別」記載於保單面頁，分 A 型、B 型、C 型與 D 型四種。
- 三、「保險金額」係指被保險人身故或完全殘廢時，依要保人於要保書選擇之「保險型別」，本公司應給付之保險金。
  - A 型：「保險金額」為「保單帳戶價值」乘以「保險金最低比率」之金額，但不低於「基本保額」。
  - B 型：「保險金額」為「保單帳戶價值」與「基本保額」的總和，但不低於「保單帳戶價值」乘以「保險金最低比率」之金額。
  - C 型：「保險金額」為「保單帳戶價值」，但不低於「基本保額」。
  - D 型：「保險金額」為「保單帳戶價值」與「基本保額」的總和。

- 四、「保險金比率」，係指於要保人投保及每次繳交「保險費」時，「保險金額」除以投資相關部分之價值，其值應不低於被保險人之到達年齡所對應之「保險金最低比率」（詳如附件一）。
- 本款所稱投資相關部分之價值，係指「保單帳戶價值」加計當次預定繳交之「保險費」扣除「保單附加費用」之餘額。
- 五、「保險費」係指要保人實際交付之保險費，分「參考保險費」及「彈性保險費」二種。
- 六、「參考保險費」係指要保人於投保當時自訂每期預計交付之保險費。每期交付之保險費，係分為年繳、半年繳、季繳及月繳等四種，本公司將明列於要保書供要保人選擇。
- 要保人交付之保險費，須先補足已經過保單年度（包括當期）未繳之「參考保險費」。要保人經本公司同意得變更該「參考保險費」，若有任何變更則以變更後之「參考保險費」為準。
- 七、「彈性保險費」係指要保人累積交付的保險費超過已經過保單年度（包括當期）所累積的「參考保險費」者，其超過部份的保險費歸類為「彈性保險費」。但本公司保留接受與否的權利。
- 八、「淨保險費」係指要保人實際交付之「保險費」扣除「保單附加費用」後之餘額。
- 九、「保單附加費用」係指本契約運作所需之行政及銷售費用，如核保、發單、業務及服務人員成本，要保人繳納「保險費」時，本公司由其所繳交的「保險費」中直接扣除。其保單附加費用率詳如附件二。
- 十、「投資相關費用」及「結構型債券暫存帳戶轉出費用」之收取詳如附件二。
- 十一、「投資標的」係指本契約提供要保人選擇之投資工具總稱，詳如附件三。本公司經主管機關核准或備查後，得依第十四條之約定增加、關閉或終止非結構型債券之「投資標的」。
- 十二、「投資標的帳戶價值」係指依各「投資標的」之特性計算所得之價值，其計算方式如附件三。
- 十三、「結構型債券暫存帳戶」係指依第五條、第十一條及第十五條約定將欲投入每一結構型債券之金額投入該結構型債券前之各暫存帳戶。
- 十四、「結構型債券暫存帳戶價值」係指「結構型債券暫存帳戶」以單利方式逐日計算之本利和。計算利息之利率，為每月第一個營業日「利率參考機構」牌告與各「結構型債券暫存帳戶」相同幣別之活期儲蓄存款年利率，並公佈於本公司網站（<http://www.transglobe.com.tw>）。
- 十五、「保單帳戶價值」係指下列三項數值加總所得之金額：
- (一)各項「投資標的帳戶價值」依第三條約定轉換為等值新台幣之總和。
  - (二)各項「結構型債券暫存帳戶價值」依第三條約定轉換為等值新台幣之總和。
  - (三)尚未配置於「投資標的」或「結構型債券暫存帳戶」之「淨保險費」。
- 十六、「結構型債券發行日」係指各結構型債券發行之日期，並記載於結構型債券投資報酬與風險告知書上。
- 十七、「結構型債券到期日」係指各結構型債券到期之日期，並記載於結構型債券投資報酬與風險告知書上。
- 十八、「結構型債券到期金」係指按約定之「結構型債券到期金」計算公式計算之金額。各「結構型債券到期金」計算公式請參閱附件四。
- 十九、「結構型債券投資期間」係指各該「結構型債券發行日」起算至該「結構型債券到期日」之期間，並記載於結構型債券投資報酬與風險告知書上。
- 二十、「結構型債券發行或保證機構」係指發行或保證結構型債券之機構（詳如附件四）。
- 二十一、「結構型債券淨投資金額」係指各該「結構型債券發行日」前一日之「結構型債券暫存帳戶價值」，於各該「結構型債券發行日」當日依第三條約定轉換為與該結構型債券相同計價幣別等值之金額。
- 若有自結構型債券帳戶價值中部分提領、轉出或扣除「每月保單費用扣除額」，則自該結構型債券帳戶價值中部分提領、轉出或扣除「每月保單費用扣除額」後，「結構型債券淨投資金額」將依部分提領、轉出或扣除「每月保單費用扣除額」之金額相對於部分提領、轉出或扣除「每月保單費用扣除額」前的結構型債券帳戶價值所減少之比例做調整。計算「結構型債券到期金」亦以此調整後之「結構型債券淨投資金額」為基準。

- 二十二、「結構型債券市價相對價格比率」係由「結構型債券發行或保證機構」所提供，並公布於本公司網站 (<http://www.transglobe.com.tw>)。
- 二十三、「保單費用扣款日」係指保險單面頁所載契約生效日及其未來每個月相同的日期，如當月份無該日期，則以次月的第一個「評價日」為「保單費用扣款日」。
- 二十四、「到達年齡」係指本契約生效時被保險人之投保年齡加上經過的保單年度，即每達一保單週年日即加計一歲。投保年齡之計算請詳閱第三十八條條文。
- 二十五、「危險保額」係指「保險金額」扣除「保單帳戶價值」之餘額。
- 二十六、「死亡發生率」以不高於臺灣壽險業第四回經驗生命表死亡率的百分之百（如附件二之一）為限，本公司將於每年十二月最後一個「評價日」前於本公司網站 (<http://www.transglobe.com.tw>) 公告下一年度之「死亡發生率」。
- 二十七、「每月保險成本」係於每個「保單費用扣款日」，依被保險人的「到達年齡」與性別所對應之「死亡發生率」乘以「危險保額」除以十二所得之金額。
- 二十八、「每月保單費用扣除額」包含下列二項之和：
- (一) 本契約的「每月保險成本」。
  - (二) 每月「保單行政管理費用」（詳如附件二）。
- 二十九、「保單行政管理費用」係指本公司在本契約有效期間內，自「保單帳戶價值」中扣除之費用，以支應保單維護之行政費用。
- 三十、「投資分配比例」係指按要保人於要保書所記載之「投資分配比例」，其總和須為百分之百。要保人經本公司同意得申請變更該「投資分配比例」，若有任何變更則以變更後之「投資分配比例」為準。
- 三十一、「三行庫」係指臺灣銀行股份有限公司、第一商業銀行股份有限公司及合作金庫銀行股份有限公司。若本款定義之內容有變動，本公司將報主管機關備查並於一個月內於網站 (<http://www.transglobe.com.tw>) 公告或以書面通知要保人。
- 三十二、「評價日」係指「投資標的」之報價市場或證券交易所之營業日，且為中華民國銀行商業同業公會全國聯合會所定銀行之營業日。但「投資標的」為結構型債券者，其「評價日」為該結構型債券所連結之標的所屬報價市場共同之營業日。
- 三十三、「利率參考機構」係指第一商業銀行股份有限公司。若本款定義之內容有變動，本公司將報主管機關備查並於一個月內於網站 (<http://www.transglobe.com.tw>) 公告或以書面通知要保人。

### **第三條【貨幣單位與匯率計算基準】**

本契約「保險費」之收取與各項金額之給付，皆以新台幣為貨幣單位；本契約「投資標的帳戶價值」之計算則以「投資標的」計價幣別為貨幣單位。

本契約匯率計算方式約定如下：

- 一、欲投入結構型債券之「結構型債券暫存帳戶價值」，其匯率計算日為該「結構型債券發行日」前一「評價日」，且匯率計算方式約定如下：
- (一) 轉出「結構型債券暫存帳戶」：依「三行庫」該「結構型債券暫存帳戶」計價幣別收盤買入即期匯率之平均值為計算基準。
  - (二) 轉入該結構型債券：依「三行庫」該結構型債券計價幣別收盤賣出即期匯率之平均值為計算基準。
  - (三) 若「結構型債券暫存帳戶」與該結構型債券為相同計價幣別者，則無貨幣轉換之適用。
- 二、欲投入非結構型債券之「投資標的」之「淨保險費」，依第五條第二款約定之投資分配時間點之前一「評價日」之「三行庫」該「投資標的」計價幣別收盤賣出即期匯率之平均值為計算基準。
- 三、給付結構型債券之收益分配或到期金、部分提領「保單帳戶價值」或給付解約金及各項保險金：

其貨幣兌換匯率係以給付各該金額（第十條、第十一條、第十六條、第二十條、第二十三條、第二十四條及第二十五條）所約定之計價日當日之「三行庫」該外幣收盤買入即期匯率之平均值為計算基準。

四、要保人依第十五條約定申請「投資標的」轉換時，其匯率計算方式約定如下：

（一）轉出：依第十五條所約定轉出計價日當日之「三行庫」該外幣收盤買入即期匯率之平均值為計算基準。

（二）轉入：依第十五條所約定轉入計價日當日之「三行庫」該外幣收盤賣出即期匯率之平均值為計算基準。

（三）「投資標的」之轉換若為相同計價幣別者，則無貨幣轉換之適用。

五、「每月保單費用扣除額」，依第十二條所約定之個別帳戶價值計價幣別及「保單費用扣款日」當日之「三行庫」該外幣收盤買入即期匯率之平均值為計算基準。

#### **第四條【保險責任的開始及交付保險費】**

本公司應自同意承保並收取第一期「保險費」後負保險責任，並應發給保險單作為承保的憑證。

本公司如於同意承保前，預收相當於第一期「保險費」之金額時，其應負之保險責任，以同意承保時溯自預收相當於第一期「保險費」金額時開始。

前項情形，在本公司為同意承保與否之意思表示前發生應予給付之保險事故時，本公司仍負保險責任。

#### **第五條【淨保險費投資分配的時間點】**

一、欲將「淨保險費」投入結構型債券者，其規範如下：

本契約首期「淨保險費」及於契約撤銷期期滿前繳交的續期「淨保險費」之投資分配的時間點為契約撤銷期期滿後之次一「評價日」。本公司將首期「淨保險費」及於契約撤銷期期滿前繳交的續期「淨保險費」，依「利率參考機構」每月第一個營業日公告之新台幣活期儲蓄存款年利率，按單利方式逐日計算至契約撤銷期期滿日之本利和，依「投資分配比例」分別投入各「結構型債券暫存帳戶」。

二、欲將「淨保險費」投入非結構型債券之「投資標的」者，其規範如下：

本契約首期「淨保險費」及於契約撤銷期期滿前繳交的續期「淨保險費」之投資分配的時間點為契約撤銷期期滿後之次一「評價日」。本公司將首期「淨保險費」及於契約撤銷期期滿前繳交的續期「淨保險費」，依「利率參考機構」每月第一個營業日公告之新台幣活期儲蓄存款年利率，按單利方式逐日計算至契約撤銷期期滿日之本利和，依「投資分配比例」及第三條約定之匯率計算基準分別投入個別「投資標的」。

要保人如於契約撤銷期期滿後繳交續期「保險費」，其續期「淨保險費」投資分配的時間點為本公司收到續期「保險費」並經確認後之次一「評價日」，並依「投資分配比例」及第三條約定之匯率計算基準分別投入個別「投資標的」。

#### **第六條【契約撤銷權】**

要保人於保險單送達的翌日起算十日內，得以書面檢同保險單向本公司撤銷本契約。

要保人依前項規定行使本契約撤銷權者，撤銷的效力應自要保人書面之意思表示到達翌日零時起生效，本契約自始無效，本公司應無息退還要保人所繳「保險費」；本契約撤銷生效後所發生的保險事故，本公司不負保險責任。但契約撤銷生效前，若發生保險事故者，視為未撤銷，本公司仍應依本契約規定負保險責任。

#### **第七條【第二期以後保險費的交付、寬限期間及契約效力的停止】**

分期繳納的第二期以後「保險費」，應照本契約所載交付方法，向本公司所在地或指定地點交付，並交付本公司開發之憑證。

約定以金融機構轉帳或其他方式交付第二期以後的分期保險費者，本公司於知悉未能依此項約定受領保險費時，應將該未受領保險費之事實以書面通知要保人。

「保單帳戶價值」扣除保險單借款本息後之餘額，不足以支付當期的「每月保單費用扣除額」時，本公司應以書面催告要保人交付「保險費」，並自催告到達翌日起算三十日內為寬限期。逾寬限期仍未交付者，本契約自寬限期終了翌日起停止效力。如在寬限期內發生保險事故時，本公司仍依本契約第二十三條、第二十四條及第二十五條之約定給付各項保險金，本契約效力即行終止。

本契約停止效力後如有「保單帳戶價值」，本公司應主動退還停效日後之次一「評價日」計算之「保單帳戶價值」。

### **第八條【保險費繳交之限制】**

要保人每次繳交保險費時，其「保險金比率」應不低於「保險金最低比率」，始得繳交該保險費。

前項應符合之「保險金比率」，依下列繳費別判定：

一、定期定額繳交「保險費」者：於本公司列印保險費繳費通知單時重新計算，並以列印保險費繳費通知單前一「評價日」計算之「保單帳戶價值」為準。

二、彈性繳交「保險費」者：於要保人每次繳交保險費時重新計算，並以本公司收到「保險費」之前一「評價日」計算之「保單帳戶價值」為準。

本公司於列印保險費繳費通知單時，如經計算其「保險金比率」低於本契約附件一所示被保險人之到達年齡所對應之「保險金最低比率」者，本公司將以書面通知要保人得依本契約第三十二條申請增加「基本保額」。要保人應於「保險金比率」符合本契約附件一所示被保險人之到達年齡所對應之「保險金最低比率」後，始得繳交該定期定額之保險費。

本公司於收到要保人彈性繳交之「保險費」後，如經計算其「保險金比率」低於本契約附件一所示被保險人之到達年齡所對應之「保險金最低比率」者，本公司將無息返還要保人當次已繳交之「保險費」，並以書面通知要保人得依本契約第三十二條申請增加「基本保額」，以使「保險金比率」符合本契約附件一所示被保險人之到達年齡所對應之「保險金最低比率」後，始得繳交保險費。

### **第九條【本契約效力的恢復】**

本契約停止效力後，要保人得在停效日起二年內申請復效，申請日並不得遲於保險期間屆滿日。

要保人於停止效力之日起六個月內提出前項復效申請，並經要保人清償寬限期間欠繳之「每月保單費用扣除額」，如有第三十四條第一項所約定保單帳戶價值不足扣抵保險單借款時，應一併清償保險單借款本息，並另外繳交至少相當於三個月之「參考保險費」後，自翌日上午零時起，開始恢復其效力。

要保人於停止效力之日起六個月後提出第一項之復效申請者，本公司得於要保人之復效申請送達本公司之日起五日內要求要保人提供被保險人之可保證明。

本公司未於前項約定期限內要求要保人提供可保證明，或於收齊可保證明後十五日內不為拒絕者，視為同意復效。於要保人清償寬限期間欠繳之「每月保單費用扣除額」，如有第三十四條第一項所約定保單帳戶價值不足扣抵保險單借款時，應一併清償保險單借款本息，並另外繳交至少相當於三個月之「參考保險費」後，自翌日上午零時起，開始恢復其效力。

第三項被保險人之危險程度有重大變更已達拒絕承保程度者，本公司得拒絕其復效。

要保人依第三項提出申請復效者，於交齊可保證明、清償寬限期間欠繳之「每月保單費用扣除額」，如有第三十四條第一項所約定保單帳戶價值不足扣抵保險單借款時，應一併清償保險單借款本息，並另外繳交至少相當於三個月之「參考保險費」後，自翌日上午零時起，開始恢復其效力。

第二項及第六項繳交之「保險費」扣除「保單附加費用」後之餘額，於復效後之次一「評價日」，依第五條之約定投入各「投資標的」。

契約效力恢復時，本公司按日數比例收取當期未經過期間之「每月保單費用扣除額」，以後仍依第十二條之約定於每個「保單費用扣款日」扣除「每月保單費用扣除額」。

第一項約定期限屆滿時，本契約效力即行終止。

## 第十條【投資標的之收益分配】

本契約所提供之「投資標的」如有收益分配時，應以本公司持有該「投資標的」之收益份額，依本契約所持該「投資標的」價值佔本公司所持該「投資標的」總價值之比例，將該收益分配予要保人，但若有依法應先扣繳之稅捐時，本公司應先扣除之。

前項要保人所分配之收益，本公司依下列方式給付：

一、「投資標的」為結構型債券者，本公司將於該收益分配日前一個月，以書面通知要保人，要保人應於收益分配日前五個工作日通知本公司該收益分配於收益分配日(計價日)之處理方式，其可選擇之處理方式為下列兩者之一：

(一)將該收益分配依第三條約定轉換為等值新台幣後以現金給付。

(二)將該收益分配投入與其相同幣別之貨幣帳戶。

若要保人未於收益分配日前五個工作日將申請文件送達本公司，則將該收益分配投入與其相同幣別之貨幣帳戶；若本契約無與該收益分配相同幣別之貨幣帳戶，則分配至新台幣貨幣帳戶。

若收益分配以現金給付時，本公司應於該收益分配日起算一個月內主動給付；逾期本公司應加計利息給付，其利息以當曆月第一營業日「三行庫」牌告「二年期定期儲蓄存款固定年利率」之平均值計算。

二、「投資標的」為非結構型債券者，本公司應將分配之收益於其實際分配日投入該「投資標的」。

本公司得變更前項收益分配之處理方式，並經主管機關核准或備查後一個月內以書面通知要保人。

## 第十一條【結構型債券到期金之選擇】

當個別結構型債券到期時，要保人處理到期金的方式有以下選擇：

一、「保單帳戶價值」部分提領方式領回該筆到期金，本公司將以該「結構型債券到期日」為計價日。

二、將該筆到期金重新分配至「投資標的」：

(一)欲重新分配至結構型債券者，則應於申請文件中指定欲重新分配之結構型債券，該筆到期金於扣除結構型債券申購手續費後，投入與該筆到期金相同幣別之「結構型債券暫存帳戶」中，於欲重新分配之「結構型債券發行日」當日，將「結構型債券發行日」前一日之「結構型債券暫存帳戶價值」依第三條約定轉換之金額，投入欲重新分配之結構型債券。前述結構型債券申購手續費以不超過「結構型債券到期金」之5%為限，詳如附件二。

(二)欲重新分配至非結構型債券之「投資標的」者，則應於申請文件中指定欲重新分配之非結構型債券之「投資標的」，本公司將以該「結構型債券到期日」為計價日，並將該筆到期金重新分配至要保人所選擇之「投資標的」。

本公司應於「結構型債券到期日」三十日前，以書面文件通知要保人行使前項選擇之權利，要保人應於「結構型債券到期日」之前五個工作日將申請文件送達本公司。若要保人未於期限內將申請文件送達本公司，則將該「結構型債券到期金」投入與其相同幣別之貨幣帳戶；若本契約無與該「結構型債券到期金」相同幣別之貨幣帳戶，則分配至新台幣貨幣帳戶。

## 第十二條【每月保單費用扣除額】

本公司於每「保單費用扣款日」，先依非結構型債券之個別「投資標的帳戶價值」比例分攤贖回扣除「每月保單費用扣除額」，若非結構型債券之個別「投資標的帳戶價值」之總和不足抵扣「每月保單費用扣除額」時，則不足之金額再依個別「結構型債券暫存帳戶價值」比例分攤扣除之，若個別「結構型債券暫存帳戶價值」之總和仍不足抵扣時，則不足之金額再依個別結構型債券帳戶價值比例分攤贖回扣除之。

## 第十三條【保單帳戶價值的通知】

本公司將於本契約有效期間內，每季以書面通知要保人「保單帳戶價值」及其保單狀況，包括下列項目：

一、投資組合現況；

- 二、期初各「投資標的帳戶價值」及各「結構型債券暫存帳戶價值」；
- 三、當期部分提領金額；
- 四、當期收受之「保險費」金額；
- 五、當期已扣除之各項費用明細；
- 六、期末各「投資標的帳戶價值」及各「結構型債券暫存帳戶價值」；
- 七、期末之「保險金額」及解約金；
- 八、期末保險單借款之本息。

#### **第十四條【非結構型債券之投資標的的增加、關閉及終止】**

本公司報經主管機關核准或備查後，得依下列方式調整非結構型債券之「投資標的」：

- 一、增列新的「投資標的」。
- 二、關閉特定之「投資標的」：此特定之「投資標的」一經關閉後即禁止轉入及再投資。本公司應於主管機關核准或備查後一個月內，以書面通知要保人。要保人應於接獲通知後三十日內，以書面回覆本公司欲變更之「投資標的」及分配比例。逾期未回覆時，本公司得逕剔除該關閉之「投資標的」後，就要保人所指定之其餘「投資標的」（不含結構型債券）之「投資分配比例」重新計算相對百分比，以作為未來「投資分配比例」之依據。如要保人未指定其餘「投資標的」（不含結構型債券）者，本公司將尚未投入該「投資標的」之續期「淨保險費」及該「投資標的帳戶價值」依第三條約定之匯率轉換為等值之新台幣存放至其「新台幣貨幣帳戶」中。
- 三、終止特定之「投資標的」：本公司應於主管機關核准或備查後一個月內，以書面通知要保人。要保人應於接獲通知後三十日內，以書面回覆本公司欲變更之「投資標的」及分配比例。逾期未回覆時，本公司得逕剔除該終止之「投資標的」後，就要保人所指定之其餘「投資標的」（不含結構型債券）之「投資分配比例」重新計算相對百分比，以作為終止之標的帳戶價值的轉換以及未來「投資分配比例」之依據。如要保人未指定其餘「投資標的」（不含結構型債券）者，本公司將尚未投入該「投資標的」之續期「淨保險費」及該「投資標的帳戶價值」依第三條約定之匯率轉換為等值之新台幣存放至其「新台幣貨幣帳戶」中。

非結構型債券之「投資標的」發行機構不接受特定非結構型債券之「投資標的」之申購時，本公司應於接獲該「投資標的」發行機構書面通知之翌日起算十個工作日內以書面通知要保人。要保人應於接獲通知後於指定期限內，以書面回覆本公司欲變更之「投資標的」及分配比例。逾期未回覆時，本公司得逕剔除該「投資標的」後，就要保人所指定之其餘「投資標的」（不含結構型債券）之「投資分配比例」重新計算相對百分比，以作為未來「投資分配比例」之依據。如要保人未指定其餘「投資標的」（不含結構型債券）者，本公司將尚未投入該「投資標的」之續期「淨保險費」及該「投資標的帳戶價值」依第三條約定之匯率轉換為等值之新台幣存放至其「新台幣貨幣帳戶」中。若本公司接獲要保人書面回覆前，前述該「投資標的」不接受申購情形已解除，本公司將其後之續期「淨保險費」依要保人原約定之「投資分配比例」分配至該「投資標的」，並以書面通知要保人。

因第一項第二款、第三款及第二項情形發生之轉換，本公司不計入轉換次數，亦不收取轉換費用。

#### **第十五條【投資標的轉換】**

要保人得以書面申請將特定「投資標的」或「結構型債券暫存帳戶」之部分或全部帳戶價值轉換至其他可供投資分配之「投資標的」。

有關各「投資標的」申請轉出及轉入之規定，詳如附件三。

#### **第十六條【保單帳戶價值的部分提領】**

要保人得在本契約有效期間內以書面申請部分提領其「保單帳戶價值」。但每次提領後的「保單帳戶價值」扣除保險單借款本息後之金額不得低於新台幣一萬元。有關各「投資標的」及「結構型債券暫存帳戶」申請部分提

領之規定，詳如附件三。

如「保險型別」為 A 型或 C 型者，部分提領後之「基本保額」依下列規定辦理：

一、「保險型別」為 A 型者：

(一) 申請部分提領當時的「保單帳戶價值」乘以「保險金最低比率」小於或等於「基本保額」時，則「基本保額」等於原「基本保額」扣除部分提領的「保單帳戶價值」金額，但不得低於本契約最低承保金額。

(二) 申請部分提領當時的「保單帳戶價值」乘以「保險金最低比率」大於「基本保額」時，則部分提領後的「基本保額」為下列兩者較小值，但不得低於本契約最低承保金額。

1、申請當時的「基本保額」。

2、申請當時「保單帳戶價值」乘以「保險金最低比率」之金額，再扣除部分提領的「保單帳戶價值」金額。

二、保險型別為 C 型者，部分提領後的「基本保額」為申請當時的「基本保額」扣除部分提領的「保單帳戶價值」金額，但不得低於本契約最低承保金額。

如保險型別為 B 型或 D 型者，本契約之「基本保額」維持不變。

### **第十七條【投資標的或「結構型債券暫存帳戶」於部分提領、轉換或解約時的計價方式】**

要保人申請個別「投資標的」或「結構型債券暫存帳戶」部分提領、轉換或解約時，其計價方式詳如附件三。

### **第十八條【轉換時費用扣除的時點】**

要保人於同一次申請轉換之「投資標的」若有不同的計價日，則本公司將各「投資標的」依附件三所列個別計價日分別計算實際可轉出金額後，由第一筆可轉出金額中扣除該次申請之各項費用（詳附件二）總和，若不足則由次一筆可轉出金額中扣除。

### **第十九條【告知義務與本契約的解除】**

要保人或被保險人在訂立本契約時，對於本公司要保書書面詢問的告知事項應據實說明，如有故意隱匿，或因過失遺漏或為不實的說明，足以變更或減少本公司對於危險的估計者，本公司得解除契約，其保險事故發生後亦同。但危險的發生未基於其說明或未說明的事實時，不在此限。

前項解除契約權，自本公司知有解除之原因後，經過一個月不行使而消滅；或自契約訂立後，經過二年不行使而消滅。

本公司通知解除契約時，如要保人身故，或居所不明，致通知不能送達時，本公司得將該項通知送達受益人。

本公司依第一項解除契約時，應將解除契約之次一「評價日」「保單帳戶價值」返還予要保人。

### **第二十條【契約的終止】**

要保人得隨時終止本契約。

前項契約之終止，自本公司收到要保人書面通知時，開始生效。

要保人繳費累積達有「保單帳戶價值」而終止契約時，本公司應於接到通知後一個月內償付解約金。解約金係依附件三所列計價日及計價方式計算。若有未還清之保險單借款本息，前述解約金需先清償保險單借款本息（計算至本公司接到通知當日）。逾期本公司應加計利息給付，其利息按年利率一分計算。

### **第二十一條【保險事故的通知與保險金的申請時間】**

要保人或受益人應於知悉本公司應負保險責任之事故後十日內通知本公司，並於通知後儘速檢具所需文件向本公司申請給付保險金，本公司將以文件收齊日之次一「評價日」的「保單帳戶價值」，計算應給付之保險金。本公司給付保險金後，本契約效力即行終止。

本公司應於收齊前項文件後十五日給付之。但因可歸責於本公司之事由致未在前述約定期限內為給付者，應按

年利一分加計利息給付。

## **第二十二條【失蹤處理】**

被保險人在本契約有效期間內失蹤者，如經法院宣告死亡時，本公司根據判決內所確定死亡時日為準，依本契約第二十三條之約定給付身故保險金或喪葬費用保險金；如要保人或受益人能提出證明文件，足以認為被保險人極可能因意外傷害事故而死亡者，本公司應依意外傷害事故發生日為準，依本契約第二十三條之約定給付身故保險金或喪葬費用保險金。但日後發現被保險人生還時，受益人應將該筆已領之身故保險金或喪葬費用保險金歸還本公司，本契約自原終止日繼續有效，本公司如有應行給付其他保險金情事者，仍依約給付，並將按計算身故保險金或喪葬費用保險金當時之「保單帳戶價值」，依要保人指定之「投資分配比例」，於歸還日之次一「評價日」分配至各「投資標的」。

## **第二十三條【身故保險金或喪葬費用保險金的給付】**

被保險人於本契約有效期間內身故時，本公司按「保險金額」給付身故保險金後，本契約效力即行終止。

受益人依第二十七條規定申領保險金時，若已超過第四十二條所約定之時效，則本公司以檢齊所須文件送達之次一「評價日」為基準計算之「保單帳戶價值」償付要保人後，「保單帳戶價值」即為結清，本契約效力即行終止。

若因受益人延遲通知而致本公司於被保險人身故後仍依第十二條約定扣繳「每月保單費用扣除額」時，本公司應無息退還該「每月保單費用扣除額」並併入「身故保險金或喪葬費用保險金」給付。

（以下條款適用D型）訂立本契約時，以未滿十四足歲之未成年人，或心神喪失或精神耗弱之人為被保險人，其身故保險金之「保險金額」部分（不論其給付方式或名目），均變更為喪葬費用保險金。

前項喪葬費用保險金額，不包含其屬投資部分之「保單帳戶價值」。

以未滿十四足歲之未成年人，或心神喪失或精神耗弱之人為被保險人，於民國九十年七月十一日（含）以後所投保之喪葬費用保險金額總和（不限本公司），不得超過主管機關所訂定之喪葬費用保險金額上限，其超過部分本公司不負給付責任。

前項情形，如要保人向二家（含）以上保險人投保，或向同一保險人投保數個保險契約，且其投保之喪葬費用保險金額合計超過主管機關所定之限額者，本公司於所承保之喪葬費用金額範圍內，依各要保書所載之要保時間先後，依約給付喪葬費用保險金額至主管機關所訂定之喪葬費用保險金額上限為止，如有二家以上保險人之保險契約要保時間相同或無法區分其要保時間之先後者，各該保險人應依其喪葬費用保險金額與扣除要保時間在先之保險人應理賠之金額後所餘之限額比例分擔其責任。

前二項所稱主管機關所訂定之喪葬費用額度上限如下：

- 一、民國九十一年十二月三十一日（含）以前為新台幣一百萬元。
- 二、民國九十二年一月一日起調整為新台幣二百萬元。
- 三、民國九十二年十月一日起要保之簡易人壽保險契約其喪葬費用保險金額應合併計算。

## **第二十四條【完全殘廢保險金的給付】**

被保險人於本契約有效期間內致成附件五所列完全殘廢情事之一者，本公司按「保險金額」給付完全殘廢保險金。被保險人同時有兩項以上殘廢時，本公司只給付一項完全殘廢保險金。本公司給付完全殘廢保險金後，本契約效力即行終止。

受益人依第二十八條規定申領保險金時，若已超過第四十二條所約定之時效，則本公司以檢齊所須文件送達之次一「評價日」為基準計算之「保單帳戶價值」償付要保人後，「保單帳戶價值」即為結清，本契約效力即行終止。

若因受益人延遲通知而致本公司於被保險人完全殘廢後仍依第十二條約定扣繳「每月保單費用扣除額」時，本公司應無息退還該「每月保單費用扣除額」並併入「完全殘廢保險金」給付。

## **第二十五條【一百一十一祝壽保險金的給付】**

若被保險人於本契約有效期間內到達年齡為一百一十一歲之保單週年日仍生存時，本公司按當時之「保險金額」給付「一百一十一祝壽保險金」後，本契約效力即行終止。

前項「保單帳戶價值」之計價日為依第二十六條約定之申領文件收齊日之次一「評價日」。

## **第二十六條【一百一十一祝壽保險金的申領】**

受益人申領「一百一十一祝壽保險金」時，應檢具下列文件：

- 一、保險單或其謄本。
- 二、保險金申請書。
- 三、受益人的身分證明。

## **第二十七條【身故保險金或喪葬費用保險金的申領】**

受益人申領「身故保險金」或喪葬費用保險金時，應檢具下列文件：

- 一、保險單或其謄本。
- 二、被保險人死亡證明書或除戶戶籍謄本。
- 三、保險金申請書。
- 四、受益人的身分證明。

## **第二十八條【完全殘廢保險金的申領】**

受益人申領「完全殘廢保險金」時，應檢具下列文件：

- 一、保險單或其謄本。
- 二、殘廢診斷書。
- 三、保險金申請書。
- 四、受益人的身分證明。

受益人申領「完全殘廢保險金」時，本公司得對被保險人的身體予以檢驗，必要時並得經受益人同意調閱被保險人之就醫相關資料，其費用由本公司負擔。

## **第二十九條【除外責任】**

有下列情形之一者，本公司不負給付保險金的責任。

- 一、要保人故意致被保險人於死。
- 二、被保險人故意自殺或自成附件五所列完全殘廢情事之一者。但自契約訂立或復效之日起二年後故意自殺致死者，本公司仍負給付身故保險金或喪葬費用保險金之責任。
- 三、被保險人因犯罪處死或拒捕或越獄致死或致成附件五所列完全殘廢情事之一者。

前項第一款及第三十條情形致被保險人成附件五所列完全殘廢情事之一者，本公司按第二十四條的約定給付完全殘廢保險金，本契約效力即行終止。

因第一項各款情形而免給付保險金者，本契約累積達有「保單帳戶價值」時，依照約定給付「保單帳戶價值」予應得之人，本契約效力即行終止。

前項「保單帳戶價值」之計算，以要保人或受益人備齊文件送達本公司的次一「評價日」為計價日。

## **第三十條【受益人之受益權】**

身故保險金或喪葬費用保險金受益人故意致被保險人於死或雖未致死者，喪失其受益權。

前項情形，如因該受益人喪失受益權，而致無受益人受領「保險金額」時，其「保險金額」作為被保險人遺產。如有其他受益人者，喪失受益權之受益人原應得之部份，按其他受益人原約定比例分歸其他受益人。

## **第三十一條【未還款項的扣除】**

本公司給付下列各項金額時，應先扣除本契約保險單借款及其應付利息：

- 一、依第十條之約定給付「投資標的」之收益分配。
- 二、依第十一條之約定給付或重新分配之「結構型債券到期金」。
- 三、依第十六條約定給付「保單帳戶價值」。
- 四、依第二十條之約定給付解約金。
- 五、依第二十三條約定給付「身故保險金或喪葬費用保險金」。
- 六、依第二十四條約定給付「完全殘廢保險金」。
- 七、依第二十五條約定給付「一百一十一祝壽保險金」。
- 八、依第三十八條之約定因年齡錯誤退還「保單帳戶價值」、累計溢扣之保險成本與費用總額。

### **第三十二條【基本保額之變更】**

要保人在本契約有效期間內，得申請減少「基本保額」，但是減額後的「基本保額」，不得低於本保險最低承保金額，其減少部分視為終止契約。

前項減少「基本保額」之申請，自本公司收到申請文件日之次一個「保單費用扣款日」生效。

「基本保額」減少後，未來之「危險保額」將按減少後之「基本保額」依「保險型別」計算。

要保人在本契約有效期間內，得申請增加「基本保額」，但要保人申請增加「基本保額」時，需經本公司同意後始得增加，且申請增額後之本契約「基本保額」不得超過本保險最高承保金額。

### **第三十三條【基本保額增加的選擇權】**

被保險人按標準體承保者，本公司應依要保人、被保險人於要保書約定同意，逐年將投保時之「基本保額」增加百分之十，且毋須檢具被保險人之可保性證明文件，若要保人於繳費期間中途不願意增加「基本保額」，得於契約週年日一個月前另以書面通知本公司撤銷當年度「基本保額」之增加。

要保人增加「基本保額」後，未來之「危險保額」將按增加後之「基本保額」依「保險型別」重新計算「每月保險成本」。

若有下列情形之一者，本契約終止增加「基本保額」：

- 一、要保人連續兩年聲明不增加「基本保額」。
- 二、被保險人年齡屆滿六十歲。
- 三、本契約之「基本保額」已達原簽約時之「基本保額」之兩倍或本公司最高承保限額。
- 四、要保人已辦理減少「基本保額」或契約轉換。

第一項增加「基本保額」比例，本公司得視通貨膨脹情況調整，但最高不得高於百分之十五，最低不得低於百分之五，且調整後之比例適用於所有有效契約之被保險人。基本保額增加的比例本公司將於網站上公告，網址為 (<http://www.transglobe.com.tw>)。本公司變更網址時，將另行通知要保人。

### **第三十四條【保險單借款】**

要保人得在「保單帳戶價值」範圍內向本公司申請保險單借款，經本公司同意後，辦理借款手續。當未償還之借款本息，超過「保單帳戶價值」百分之八十時，本公司應以書面通知要保人；如未償還之借款本息超過「保單帳戶價值」之百分之九十時，本公司應另以書面通知要保人，要保人應於此通知到達翌日起算五日內償還借款本息，若逾期仍未償還，本公司則依本契約全部「投資標的」及「結構型債券暫存帳戶」之最近一次共同「評價日」，先依非結構型債券之個別「投資標的帳戶價值」比例分攤贖回抵扣當時全部之借款本息，若非結構型債券之個別「投資標的帳戶價值」之總和不足抵扣當時全部之借款本息時，則不足之金額再依個別「結構型債券暫存帳戶價值」比例分攤贖回抵扣之，若個別「結構型債券暫存帳戶價值」之總和仍不足抵扣時，則不足之金額再依個別結構型債券帳戶價值比例分攤贖回抵扣之；若仍不足以抵扣時，本公司應以書面催告要保人償還保險單借款本息，並自催告到達翌日起算三十日內為寬限期間。若逾寬限期間仍未交付者，本契約自寬限期間終

了翌日起停止效力，並以書面通知要保人。如在寬限期內發生保險事故時，本公司仍依本契約第二十三條、第二十四條及第二十五條之約定給付各項保險金，本契約效力即行終止。

本契約因前項原因停止效力後，要保人得依第九條約定申請復效。

保險單借款之利息，以本公司每月公告之保險單借款利率計算，要保人可選擇向本公司客戶服務中心或至本公司網站查詢 (<http://www.transglobe.com.tw>)。本公司變更網址時，將另行通知要保人。

### **第三十五條【投資標的特殊情事之評價】**

#### 一、「投資標的」為結構型債券：

本契約於「結構型債券發行日」前，發生不可抗力之重大情事，本公司或結構型債券發行機構有權停止開放申購或拒絕發行該結構型債券。

本款所稱之不可抗力之重大情事係指因天災、政府行為、罷工、勞資糾紛、戰爭、軍事行動、內亂、政治動盪、群眾示威或抗議、恐怖活動、傳染病、電力或電訊中斷、法令變更、法院判決或裁定之產生、或其他類似情形且非可歸責於本公司或發行機構，導致下列情形發生：

(一)與結構型債券相關之金融市場發生市場暫停或市場中斷，該市場無法依其正常方式運作，或市場條件失序。

(二)無法取得市場報價。

前述停止開放申購或拒絕發行結構型債券之情形，本公司將返還該「結構型債券發行日」前一日各該「結構型債券暫存帳戶價值」轉換為等值新台幣金額，加計已扣除之「保單附加費用」或結構型債券申購手續費（詳如附件二）後之數額返還予要保人。前述各該「結構型債券暫存帳戶價值」轉換為新台幣之匯率，依該「結構型債券發行日」前一日「三行庫」各該外幣收盤買入即期匯率之平均值為計算基準。

本公司於返還前項金額前，若收到第二十三條（身故保險金或喪葬費用保險金）或第二十四條（完全殘廢保險金）之申請者，前項約定即不再適用，本公司按「保險型別」給付「保險金額」後，本契約效力即行終止。

本契約於「結構型債券投資期間」內，本公司給付各項保險金、解約金、返還「保單帳戶價值」及要保人部分提領該結構型債券帳戶價值時，如該結構型債券發生該「結構型債券發行機構或保證機構」因不可抗力之重大情事暫停揭露「結構型債券市價相對價格比率」之情事，本公司依前述暫停計付之情事消滅後之第一個「評價日」之該結構型債券帳戶價值計算應付之數額，於本公司收到該款項數額後給付之，本公司不負擔利息。

#### 二、「投資標的」為非結構型債券：

本契約任一非結構型債券之「投資標的」評價時，如遇該「投資標的」所屬公司因特殊情事（例如交易所暫時停止交易）暫停計算「投資標的帳戶價值」時，該「投資標的」之「投資標的帳戶價值」依下列規定辦理。

(一)「保險費」扣除相關費用後之分配時：本公司應即通知要保人延緩計算；並於該特殊情事消滅後之次一個「評價日」將資金投入該「投資標的」。

(二)要保人申請契約終止、部分提領「保單帳戶價值」時：本公司須通知要保人延緩給付，但不給付延遲利息；並於該特殊情事消滅後之次一個「評價日」計算本契約項下的全部或部分「保單帳戶價值」，並自該「評價日」起一個月內償付。

(三)要保人申請「投資標的」轉換時：本公司應即通知要保人延緩轉換；並於該特殊情事消滅後之次一個「評價日」計算欲轉換之「投資標的帳戶價值」。

本款暫停計算「投資標的帳戶價值」之特殊情事，須經「投資標的」核准之主管機關核准之。

### **第三十六條【投資風險與法律救濟】**

要保人及受益人對於「投資標的帳戶價值」須直接承擔「投資標的」之法律、匯率、市場變動風險及「投資標的」發行機構或「結構型債券發行或保證機構」之信用風險所致之損益。

本公司應盡善良管理人之義務，慎選「投資標的」，加強締約能力詳加審視雙方契約，並應注意相關機構之信用評等。

本公司對於因可歸責於「投資標的」發行機構或其代理人、代表人、受僱人之事由致生損害本「投資標的」之價值者，或其他與「投資標的」發行機構、保證機構所約定之賠償或給付事由發生時，本公司應即刻且持續向「投資標的」發行機構、保證機構進行追償。相關追償費用由本公司負擔。

前項追償之進度及結果應以適當方式告知要保人。

### **第三十七條【保險單紅利的計算及給付】**

本保險為不分紅保單，不參加紅利分配，並無紅利給付項目。

### **第三十八條【投保年齡的計算及錯誤的處理】**

要保人在申請投保時，應將被保險人出生年月日在要保書填明。被保險人的投保年齡，以足歲計算，但未滿一歲的零數超過六個月者，加算一歲。

被保險人的投保年齡發生錯誤時，依下列規定辦理：

- 一、真實投保年齡超出本公司之最高或最低承保年齡者，本契約無效，本公司將以發覺當時之「保單帳戶價值」加上累積扣除之「保單附加費用」與「每月保單費用扣除額」無息退還要保人。
- 二、因投保年齡的錯誤，而致溢扣保險成本者，本公司於發覺當時無息退還累計溢扣之保險成本。但在發生保險事故後始發覺且其錯誤發生在本公司者，本公司按最近一期扣除之保險成本與應扣保險成本的比例提高「危險保額」，而不退還溢繳部分的保險成本，本公司應給付之「保險金額」為依比例提高後的「危險保額」加「保單帳戶價值」之總和。
- 三、因投保年齡的錯誤，而致短扣保險成本者，本公司應於發覺當時通知要保人補足其累計差額。但在發生保險事故後始發覺且其錯誤並非發生在本公司者，本公司得按最近一期扣除之保險成本與應扣保險成本的比例減少「危險保額」，而不得請求補足差額，本公司應給付之「保險金額」為依比例減少後的「危險保額」加「保單帳戶價值」之總和。

前項第一款、第二款前段情形，其錯誤原因歸責於本公司者，應加計利息退還該金額，其利息按退還當時本公司公告之保險單借款利率與民法第二百零三條規定之週年利率取大者計算。

### **第三十九條【性別錯誤的處理】**

要保人在申請投保時，應將被保險人的性別在要保書上填明，如果發生錯誤應依照下列規定辦理。

- 一、性別錯誤致溢扣保險成本者，本公司應無息退還累計溢扣保險成本部份。
- 二、性別錯誤致短扣保險成本者，要保人應補足其累計差額。

前項性別錯誤係於發生保險事故後發覺者，本公司得按最近一期扣除之保險成本與應扣保險成本的比例計算「危險保額」，本公司應給付之「保險金額」為「危險保額」加「保單帳戶價值」之總和。

### **第四十條【受益人的指定及變更】**

「完全殘廢保險金」與「一百一十一祝壽保險金」的受益人，為被保險人本人，本公司不受理其指定或變更。

除前項約定外，要保人得依下列規定指定或變更受益人：

- 一、於訂立本契約時，經被保險人同意指定受益人。
- 二、於保險事故發生前經被保險人同意變更受益人，如要保人未將前述變更通知保險公司者，不得對抗保險公司。

前項受益人的變更，於要保人檢具申請書及被保險人的同意書送達本公司時，本公司應即予批註或發給批註書。

受益人同時或先於被保險人本人身故，除要保人已另行指定受益人外，以被保險人之法定繼承人為本契約受益人。

前項法定繼承人之順序及應得保險金之比例適用民法繼承編相關規定。

#### **第四十一條【變更住所】**

要保人的住所有變更時，應即以書面通知本公司。

要保人不為前項通知者，本公司之各項通知，得以本契約所載要保人之最後住所發送之。

#### **第四十二條【時效】**

由本契約所生的權利，自得為請求之日起，經過兩年不行使而消滅。

#### **第四十三條【批註】**

本契約內容的變更，或記載事項的增刪，除第四十條規定者外，應經要保人與本公司雙方書面同意，並由本公司即予批註或發給批註書。

#### **第四十四條【管轄法院】**

因本契約涉訟者，同意以要保人住所地地方法院為第一審管轄法院，要保人的住所在中華民國境外時，以臺灣臺北地方法院為第一審管轄法院。但不得排除消費者保護法第四十七條及民事訴訟法第四百三十六條之九小額訴訟管轄法院之適用。

### 【附件一】保險金最低比率

被保險人到達年齡所對應之「保險金最低比率」，其數值如下表。

|           |           |            |           |
|-----------|-----------|------------|-----------|
| 被保險人之到達年齡 | 40 歲（含）以下 | 41 歲至 70 歲 | 71 歲（含）以上 |
| 最低比率      | 130%      | 115%       | 101%      |

【附件二】費用結構

全球人壽富利變額萬能壽險保險公司收取之相關費用表

單位：新台幣元或%

| 費用項目                                 | 說明  |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
|--------------------------------------|---|------|-------|-------|-----|-------|-----|-------|-----|-------|----|---------|----|
| 一、前置費用（即「保單附加費用」）：                   |   |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| （一）基本（或目標）保費費用，即本契約「參考保險費」之「保單附加費用」。 |   |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| 第一年度：                                | 保單附加費用率以不超過 60% 為限。   |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| 續年度：                                 | 保單附加費用率以不超過下列數值為限。  |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
|                                      | <table border="1"> <thead> <tr> <th>保單年度</th> <th>參考保險費</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>第 2 年</td> <td>60%</td> </tr> <tr> <td>第 3 年</td> <td>15%</td> </tr> <tr> <td>第 4 年</td> <td>10%</td> </tr> <tr> <td>第 5 年</td> <td>5%</td> </tr> <tr> <td>第 6 年以後</td> <td>0%</td> </tr> </tbody> </table>                        | 保單年度 | 參考保險費 | 第 2 年 | 60% | 第 3 年 | 15% | 第 4 年 | 10% | 第 5 年 | 5% | 第 6 年以後 | 0% |
| 保單年度                                 | 參考保險費   |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| 第 2 年                                | 60%   |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| 第 3 年                                | 15%   |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| 第 4 年                                | 10%   |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| 第 5 年                                | 5%  |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| 第 6 年以後                              | 0%  |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
|                                      | 「保單年度」：要保人繳交保險費時，按本契約條款計算「參考保險費」所應歸屬之年度。  |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| （二）額外投資保費費用，即本契約「彈性保險費」之「保單附加費用」。    |   |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
|                                      | 保單附加費用率以不超過 5% 為限。  |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| 二、保險相關費用                             |   |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| （一）保單管理費，即本契約之每月「保單行政管理費用」           | 每張保單每月最高以不超過新台幣二百元與「保單帳戶價值」的 0.085% 二項之和為限。   |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| （二）保險成本（保險費用、保障成本）                   | 採用自然保費，每一保單年度收取之保險成本原則上逐年增加。  |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| 三、投資相關費用(註)                          |   |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| （一）「投資標的」申購手續費                       | <p>共同基金：以「投資標的」申購手續費用五折為上限。</p> <p>基金連結標的：以投入金額之 1% 為上限。</p> <p>貨幣帳戶：無。</p> <p>結構型債券：</p> <p>1. 若投入該結構型債券之資金來自於「淨保險費」者，則於投入「結構型債券暫存帳戶」前，無須扣除結構型債券申購手續費。</p> <p>2. 若投入該結構型債券之資金來自於共同基金、基金連結標的、全球精選投資帳戶、貨幣帳戶及結構型債券之轉出金額或「結構型債券到期金」者，則於投入該「結構型債券暫存帳戶」前須先扣除結構型債券申購手續費，該費用扣除通路服務費後以不超過轉出金額或「結構型債券到期金」之 5% 為限。</p> <p>全球精選投資帳戶：無。</p> |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |
| （二）「投資標的」經理費                         | <p>共同基金：投資機構收取。</p> <p>基金連結標的：投資機構收取。</p> <p>貨幣帳戶：無。</p> <p>結構型債券：無。</p> <p>全球精選投資帳戶：</p> <p>1、由所投資的共同基金及基金連結標的所屬之投資機構收取。</p> <p>2、由亞太全球證券投資顧問公司收取，詳見附件二全球人壽富利變額萬能壽險投資機構收取之相關費用表之註五。</p>  |      |       |       |     |       |     |       |     |       |    |         |    |

|                                  |  |
|----------------------------------|--|
| (三)「投資標的」保管費                     | <p>共同基金：由投資機構收取。</p> <p>基金連結標的：每一保單年度最高不超過0.1%，反映於「投資標的」單位價值中，要保人不需另外負擔。</p> <p>貨幣帳戶：無。</p> <p>結構型債券：投資機構收取。</p> <p>全球精選投資帳戶：</p> <p>1、由所投資的共同基金及基金連結標的所屬之投資機構收取。</p> <p>2、由亞太全球證券投資顧問公司收取，詳見附件二全球人壽富利變額萬能壽險投資機構收取之相關費用表之註五。</p> |
| (四)「投資標的」管理費                     | <p>共同基金：由投資機構收取。</p> <p>基金連結標的：每一保單年度最高不超過1.0%，反映於「投資標的」單位價值中，要保人不需另外負擔。</p> <p>貨幣帳戶：無。</p> <p>結構型債券：投資機構收取。</p> <p>全球精選投資帳戶：由所投資的共同基金及基金連結標的所屬之投資機構收取。</p>  |
| (五)「投資標的」贖回費用                    | <p>共同基金：投資機構收取。</p> <p>基金連結標的：無。</p> <p>貨幣帳戶：無。</p> <p>結構型債券：無。</p> <p>全球精選投資帳戶：無。</p>   |
| (六)「投資標的」轉換費用                    | <p>每一保單年度四次免費。</p> <p>自第五次起每次收取轉換費用不得高於新台幣壹仟元（自轉換的金額中扣除）。</p>  |
| (七)結構型債券發行機構之通路服務費、各項行政、管理、投資等費用 | <p>投資機構收取。</p>   |
| <b>四、後置費用</b>                    |  |
| (一) 解約費用                         | <p>無。</p>  |
| (二) 部分提領費用                       | <p>每一保單年度四次免費。</p> <p>自第五次起每次收取部份提領費用不得高於新台幣壹仟元（自部份提領的金額中扣除）。</p>  |
| <b>五、其他費用</b>                    |  |
| 「結構型債券暫存帳戶」轉出費用                  | <p>自「結構型債券暫存帳戶」轉出之金額，其欲投入非結構型債券之「投資標的」者，每次皆須扣除「結構型債券暫存帳戶」轉出費用，該費用每次以不超過轉出金額之3%為限。</p>  |

註：本公司得於所定收取費用最高上限範圍內為調整，並於費用調整生效日三個月前通知要保人。但若屬對要保人有利之費用調降，則不在此限。

全球人壽富利變額萬能壽險投資機構收取之相關費用表

| 投資標的名稱                          | 投資標的種類 | 申購手續費上限 | 經理費<br>(每年) | 保管費或<br>管理費<br>(每年) | 贖回<br>費用 |
|---------------------------------|--------|---------|-------------|---------------------|----------|
| 聯博－全球成長趨勢基金 A 股美元               | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－國際科技基金 A 股美元                 | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－國際醫療基金 A 股美元                 | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－短期債券基金 A2 股美元                | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－全球債券基金 A2 股美元                | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－美國收益基金 A2 股美元                | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－全球高收益債券基金 A2 股美元             | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－全球平衡型基金 A 股美元                | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－全球價值型基金 A 股美元                | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－全球複合型股票基金 A 股美元              | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－新興市場成長基金 A 股美元               | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－歐洲收益基金 A2 股歐元                | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 聯博－歐洲價值型基金 A 股歐元                | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－富達目標基金 2010                | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－富達目標基金 2020                | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－日本基金                       | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－歐洲基金                       | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－南歐基金                       | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－世界基金                       | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－印度聚焦基金                     | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－星馬泰基金                      | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－北歐基金                       | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－全球聚焦基金                     | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－全球金融服務基金                   | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－國際基金                       | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－歐洲小型企業基金                   | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－美元高收益基金                    | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－歐洲進取基金                     | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－英鎊債券基金                     | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－歐洲高收益基金                    | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－國際債券基金                     | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－印尼基金                       | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－美元現金基金                     | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－富達歐元目標 TM 基金 2025          | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富達基金－富達歐元目標 TM 基金 2030          | 共同基金   | 5.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 保德信滿意基金                         | 共同基金   | 0.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 保德信瑞騰基金                         | 共同基金   | 0.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 保德信債券基金                         | 共同基金   | 0.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 保德信亞太基金                         | 共同基金   | 0.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 保德信中型成長基金                       | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 保德信全球醫療生化基金                     | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富蘭克林坦伯頓成長基金 A 股                 | 共同基金   | 5.75%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－全球基金美元 A(Ydis)股   | 共同基金   | 6.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富蘭克林坦伯頓世界基金 A 股                 | 共同基金   | 5.75%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－互利歐洲基金歐元 A(acc)股  | 共同基金   | 6.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－拉丁美洲基金美元 A(Ydis)股 | 共同基金   | 6.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－金磚                | 共同基金   | 6.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |

| 投資標的名稱                              | 投資標的種類 | 申購手續費上限 | 經理費<br>(每年) | 保管費或<br>管理費<br>(每年) | 贖回<br>費用 |
|-------------------------------------|--------|---------|-------------|---------------------|----------|
| 四國基金美元 A(acc)股                      |        |         |             |                     |          |
| 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—大中華基金美元 A(acc)股       | 共同基金   | 6.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—公司債基金美元 A(Mdis)股      | 共同基金   | 6.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—全球債券基金美元 A(Mdis)股     | 共同基金   | 6.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—美國政府基金美元 A(Mdis)股     | 共同基金   | 6.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—新興國家固定收益基金美元 A(Qdis)股 | 共同基金   | 6.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 駿利資產管理基金—駿利美國高收益基金 A2 USD           | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 駿利資產管理基金—駿利美國20基金 A USD             | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 駿利資產管理基金—駿利環球生命科技基金 A 美元累計          | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 駿利資產管理基金—駿利美國各型股增長基金 A 美元累計         | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 駿利資產管理基金—駿利環球科技基金 A 美元累計            | 共同基金   | 6.25%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 群益馬拉松基金                             | 共同基金   | 1.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 群益多重收益組合基金                          | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 群益安家基金                              | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 群益安穩基金                              | 共同基金   | 1.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 群益亞太新趨勢平衡基金                         | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 群益真善美基金                             | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 群益創新科技基金                            | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 群益新興金鑽基金                            | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 日盛上選基金                              | 共同基金   | 1.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 百利達美國基金 L 股                         | 共同基金   | 0.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 百利達日本小型公司基金 L 股                     | 共同基金   | 0.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 百利達亞洲可換股債券基金 L 股                    | 共同基金   | 0.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 百利達短期英鎊基金 L 股                       | 共同基金   | 0.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)美國小型股票基金                     | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)歐洲中型股票基金                     | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)美元債券基金                       | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)歐元基金                         | 共同基金   | 4.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)生化股票基金                       | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)新興市場債券基金                     | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)歐元債券基金                       | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)策略基金—固定收益型(美元)               | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)策略基金—固定收益型(歐元)               | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)全球戰略配置精選基金(美元)               | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)美元基金                         | 共同基金   | 4.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 瑞銀(盧森堡)澳幣基金                         | 共同基金   | 4.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 德盛東方入息基金—A 類股份                      | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 德盛德利歐洲債券基金                          | 共同基金   | 3.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 德盛德利國際債券基金                          | 共同基金   | 3.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |

| 投資標的名稱  | 投資標的種類 | 申購手續費上限 | 經理費(每年) | 保管費或管理費(每年) | 贖回費用            |
|---|--------|---------|---------|-------------|-----------------|
| 德盛德利全球生物科技基金                                  | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 德盛德利全球資源產業基金                                  | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 德盛金磚四國基金—AT 累積類股(美元)                          | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 德盛日本基金  | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 德盛德利西葡基金                                      | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 德盛德利德國基金                                      | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 德盛安聯目標傘型基金之目標 2015 基金                         | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 德盛安聯目標傘型基金之目標 2020 基金                         | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 德盛安聯目標傘型基金之目標 2030 基金                         | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 霸菱東歐基金美元                                      | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 霸菱拉丁美洲基金美元                                    | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 霸菱高收益債券基金—美元季配                                | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 霸菱全球資源基金美元                                    | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 霸菱歐寶基金美元                                      | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 第一金電子證券投資信託基金                                 | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 第一金大中華證券投資信託基金                                | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 第一金歐洲動力平衡證券投資信託基金                             | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 台灣工銀 2000 高科技基金                               | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 台灣工銀大眾基金                                      | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 台灣工銀北美收益資產證券化基金                               | 共同基金   | 1.60%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 台灣工銀全球增長組合基金                                  | 共同基金   | 1.50%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 摩根富林明 JF 新興日本基金                               | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 摩根富林明 JF 亞洲基金                                 | 共同基金   | 1.50%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 摩根富林明 JF 龍揚基金                                 | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 摩根富林明 JF 價值成長基金                               | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 摩根富林明全球 α 基金                                  | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 摩根富林明新興 35 基金                                 | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 摩根富林明歐洲策略價值基金—摩根富林明歐洲策略價值(歐元)—A 股(分派)         | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| 摩根富林明東歐基金—JF 東歐(歐元)—A 股(分派)                   | 共同基金   | 8.50%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| 摩根富林明歐元股票基金—JF 歐元區(美元)—A 股(分派)                | 共同基金   | 8.50%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| 摩根富林明新興中東基金—摩根富林明新興中東(美元)—A 股(分派)             | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| 摩根富林明 JF 平衡基金                                 | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 摩根富林明新興歐洲、中東及非洲基金—摩根富林明新興歐洲、中東及非洲(美元)—A 股(分派) | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| 摩根富林明全球平衡基金                                   | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 摩根富林明 JF 安家理財基金                               | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無               |
| 摩根富林明基金—摩根富林明 JF 大中華基金                        | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| JF 印度基金                                       | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| JF 東協基金                                       | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| JF 南韓基金                                       | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| JF 泰國基金                                       | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| JF 太平洋科技基金                                    | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| JF 日本小型企業(日圓)基金                               | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| JF 澳洲基金                                       | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| JF 國際債券及貨幣基金                                  | 共同基金   | 3.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |
| JF 馬來西亞基金                                     | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 有 <sup>註三</sup> |

| 投資標的名稱                       | 投資標的種類 | 申購手續費上限 | 經理費<br>(每年) | 保管費或<br>管理費<br>(每年) | 贖回<br>費用        |
|------------------------------|--------|---------|-------------|---------------------|-----------------|
| JF 貨幣基金－港元                   | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 有 <sup>註三</sup> |
| JF 菲律賓基金                     | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 有 <sup>註三</sup> |
| 安泰 ING 債券基金                  | 共同基金   | 0.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 安泰 ING 鑫平衡組合基金               | 共同基金   | 1.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 安泰 ING 全球高股息基金累積型            | 共同基金   | 2.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 元大多福基金                       | 共同基金   | 1.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 元大亞太成長基金                     | 共同基金   | 1.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 元大店頭基金                       | 共同基金   | 1.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 元大泛歐成長基金                     | 共同基金   | 1.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 元大新主流基金                      | 共同基金   | 1.50%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 瑞士安勤黃金基金 AA                  | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 友邦環球基金－友邦環球股票基金 A            | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 友邦環球基金－友邦環球股票價值基金 A          | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 創利德(盧森堡)－全球高收益與新興市場債券基金(歐元)  | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 天達環球能源基金 C 股                 | 共同基金   | 3.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 天達環球策略股票基金 C 股               | 共同基金   | 3.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 天達環球黃金基金 C 股                 | 共同基金   | 3.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 天達環球動力基金 C 股                 | 共同基金   | 3.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 天達環球策略收益基金 C 股               | 共同基金   | 3.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 天達理財貨幣基金 C 股                 | 共同基金   | 3.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德世界黃金基金 A2 美元              | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德世界礦業基金 A2 美元              | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德拉丁美洲基金 A2 美元              | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德新能源基金 A2 美元               | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德新興市場基金 A2 美元              | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德新興歐洲基金 A2 美元              | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德歐洲特別時機基金 A2 美元            | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德環球資產配置基金 A2 美元            | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德世界金融基金 A2 美元              | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德世界能源基金 A2 美元              | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德世界健康科學基金 A2 美元            | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德歐元市場基金 A2 歐元              | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德歐洲基金 A2 歐元                | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德歐元優質債券基金 A2 歐元            | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 貝萊德策略配置基金 A2 美元              | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 安本環球－亞太股票基金                  | 共同基金   | 6.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 亨德森遠見全球科技基金                  | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 亨德森遠見泛歐小型公司基金                | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 亨德森遠見泛歐股票基金                  | 共同基金   | 5.00%   | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 施羅德環球基金系列－拉丁美洲 A1 類股份－累積單位   | 共同基金   | 4.1667% | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 施羅德環球基金系列－日本小型公司 A1 類股份－累積單位 | 共同基金   | 4.1667% | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 施羅德環球基金系列－日本股票 A1 類股份－累積單位   | 共同基金   | 4.1667% | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 施羅德環球基金系列－金磚四國 A1 類股份－累積單位   | 共同基金   | 4.1667% | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 施羅德環球基金系列－亞洲債券 A1 類股份－累積單位   | 共同基金   | 4.1667% | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |
| 施羅德環球基金系列－美元債券 A1 類股份－累積單位   | 共同基金   | 4.1667% | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無               |

| 投資標的名稱   | 投資標的種類               | 申購手續費上限             | 經理費<br>(每年) | 保管費或<br>管理費<br>(每年) | 贖回<br>費用 |
|--|----------------------|---------------------|-------------|---------------------|----------|
| 類股份－累積單位   |                      |                     |             |                     |          |
| 施羅德環球基金系列－新興市場債券<br>A1 類股份－累積單位                        | 共同基金                 | 4.1667%             | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 施羅德環球基金系列－新興亞洲 A1<br>類股份－累積單位                          | 共同基金                 | 4.1667%             | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 施羅德環球基金系列－歐元動力增長<br>A1 類股份－累積單位                        | 共同基金                 | 4.1667%             | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 施羅德環球基金系列－歐洲小型公司<br>A1 類股份－累積單位                        | 共同基金                 | 4.1667%             | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 施羅德環球基金系列－環球債券 A1<br>類股份－累積單位                          | 共同基金                 | 4.1667%             | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| MFS 全盛通脹調整債券基金 A1(美元)                                  | 共同基金                 | 6.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| MFS 全盛國際研究基金 A1(美元)                                    | 共同基金                 | 6.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 華南永昌永昌基金   | 共同基金                 | 1.40%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 華南永昌全球基礎建設基金(不配息)                                      | 共同基金                 | 2.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 華南永昌全球短期固定收益基金   | 共同基金                 | 2.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 華南永昌全球精品基金   | 共同基金                 | 2.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 復華高成長基金  | 共同基金                 | 2.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 復華數位經濟基金   | 共同基金                 | 2.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 復華中小精選基金   | 共同基金                 | 2.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 復華神盾基金   | 共同基金                 | 2.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 復華債券基金   | 共同基金                 | 2.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 木星生態基金美元   | 共同基金                 | 5.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 木星全球管理基金美元   | 共同基金                 | 5.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 木星金融機會基金美元   | 共同基金                 | 5.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 木星新興歐洲機會基金美元   | 共同基金                 | 5.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 木星歐洲特別時機基金美元   | 共同基金                 | 5.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 永豐永豐基金   | 共同基金                 | 1.50%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 永豐中小基金   | 共同基金                 | 2.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 英國保誠集團 M&G 投資基金(1)英國<br>保誠集團 M&G 全球民生基礎基金              | 共同基金                 | 5.25%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 摩根士丹利拉丁美洲股票基金 A  | 共同基金                 | 5.75%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 摩根士丹利日本價值股票基金 A  | 共同基金                 | 5.75%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 摩根士丹利歐洲、中東及非洲新興股<br>票基金 A                              | 共同基金                 | 5.75%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 德意志 DWS Invest 全球神農 A2                                 | 共同基金                 | 5.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 德意志 DWS Invest 歐洲股票 LC                                 | 共同基金                 | 5.00%               | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 標準普爾 500 指數基金<br>(iShares S&P 500 Index Fund)          | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup> | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 那斯達克 100 指數基金<br>(PowerShares QQQ Nasdaq 100)          | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup> | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 標準普爾全球 100 指數基金<br>(iShares S&P Global 100 Index Fund) | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup> | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 寶來台灣卓越 50 指數基金   | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup> | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 寶來台灣中型 100 基金  | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup> | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 標準普爾歐洲 350 指數基金<br>(iShares S&P Europe 350 Index Fund) | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup> | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 標準普爾亞洲 50 指數基金<br>(iShares S&P Asia 50 Index Fund)     | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup> | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 標準普爾中國指數基金<br>(SPDR S&P China ETF)                     | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup> | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |
| 富時新華中國 25 指數基金<br>(iShares FTSE/Xinhua China 25 Index  | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup> | 已由淨值中扣除     | 已由淨值中扣除             | 無        |

| 投資標的名稱   | 投資標的種類               | 申購手續費上限   | 經理費(每年) | 保管費或管理費(每年) | 贖回費用 |
|--|----------------------|---|---------|-------------|------|
| Fund)  |                      |   |         |             |      |
| 泛太平洋(不包含日本)指數基金<br>(iShares MSCI Pacific ex-Japan Index Fund)            | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| MSCI 日本指數基金<br>(iShares MSCI Japan Index Fund)                           | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| MSCI 新興市場指數基金<br>(iShares MSCI Emerging Markets Index Fund)              | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| MSCI 巴西指數基金<br>(iShares MSCI Brazil Index Fund)                          | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| MSCI 金磚四國指數基金<br>(iShares MSCI BRIC Index Fund)                          | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 美國 1-3 年政府票券指數基金<br>(iShares Barclays 1-3 Year Treasury Bond Fund)       | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 美國 7-10 年政府債券指數基金<br>(iShares Barclays 7-10 Year Treasury Bond Fund)     | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 美國投資級公司債券指數基金<br>(iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond Fund) | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 道瓊歐盟 50 指數基金<br>(iShares DJ EURO Stoxx 50 (DE))                          | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 道瓊原物料指數基金<br>(iShares Dow Jones U.S. Basic Materials Sector Index Fund)  | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 羅素 2000 指數基金<br>(iShares Russell 2000 Index Fund)                        | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 全球水資源指數基金<br>(POWERSHARES GLOBAL WATER PORTFOLIO)                        | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 道瓊工業指數基金<br>(DIAMONDS Trust Series I)                                    | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 德國 DAX 指數基金<br>(iShares DAX (DE))  | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 放空型那斯達克 100 指數基金<br>(Short QQQ ProShares)                                | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 放空型道瓊工業指數基金<br>(Short Dow30 ProShares)                                   | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 放空型標準普爾 500 指數基金<br>(Short S&P500 ProShares)                             | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 放空型 MSCI 新興市場指數基金<br>(Short MSCI Emerging Markets ProShares)             | 基金連結標的 <sup>註一</sup> | 1.00% <sup>註二</sup>   | 已由淨值中扣除 | 已由淨值中扣除     | 無    |
| 新台幣貨幣帳戶  | 貨幣帳戶                 | 無   | 無       | 無           | 無    |
| 日圓貨幣帳戶   | 貨幣帳戶                 | 無   | 無       | 無           | 無    |
| 美元貨幣帳戶   | 貨幣帳戶                 | 無   | 無       | 無           | 無    |
| 歐元貨幣帳戶   | 貨幣帳戶                 | 無   | 無       | 無           | 無    |
| 港幣貨幣帳戶   | 貨幣帳戶                 | 無   | 無       | 無           | 無    |
| 澳幣貨幣帳戶   | 貨幣帳戶                 | 無   | 無       | 無           | 無    |
| 紐幣貨幣帳戶   | 貨幣帳戶                 | 無   | 無       | 無           | 無    |
| 結構型債券 <sup>註四</sup>  | 結構型債券                | 結構型債券發行機構之通路服務費，以不超過「結構型債券淨投資金額」的 10% 為限。結構型債券之通路服務費、各項行政、管理、投資等費用，已反應於「結構型債券市價相對價格比率」，要保人不需另外負擔。 |         |             |      |

| 投資標的名稱      | 投資標的種類   | 申購手續費上限 | 經理費(每年)               | 保管費或管理費(每年)           | 贖回費用 |
|-------------|----------|---------|-----------------------|-----------------------|------|
| 全球精選積極型投資帳戶 | 全球精選投資帳戶 | 無       | 已由淨值中扣除 <sup>註五</sup> | 已由淨值中扣除 <sup>註五</sup> | 無    |
| 全球精選穩健型投資帳戶 | 全球精選投資帳戶 | 無       | 已由淨值中扣除 <sup>註五</sup> | 已由淨值中扣除 <sup>註五</sup> | 無    |
| 全球精選保守型投資帳戶 | 全球精選投資帳戶 | 無       | 已由淨值中扣除 <sup>註五</sup> | 已由淨值中扣除 <sup>註五</sup> | 無    |

註一：基金連結標的係指指數股票型證券投資信託基金受益憑證 (Exchange Traded Funds, ETFs)，有關基金連結標的之詳細資料請參閱本公司當時之商品說明書。

註二：在購買或贖回該「投資標的」時，證券交易商會收取固定比例之交易手續費，針對每一次下單均有最低交易手續費金額之限制。為便於保戶了解，本公司僅於保戶購買時收取1%為上限手續費（一般小額投資人的議價空間較小，約為3%），如總交易未達經濟規模金額時，本公司將自行負擔超出之手續費用，且不會轉嫁於保戶。

註三：在贖回摩根富林明歐洲策略價值基金－摩根富林明歐洲策略價值(歐元)－A 股(分派)、摩根富林明東歐基金－JF 東歐(歐元)－A 股(分派)、摩根富林明歐元股票基金－JF 歐元區(美元)－A 股(分派)、摩根富林明新興中東基金－摩根富林明新興中東(美元)－A 股(分派)、摩根富林明新興歐洲、中東及非洲基金－摩根富林明新興歐洲、中東及非洲(美元)－A 股(分派)、摩根富林明基金－摩根富林明 JF 大中華基金、JF 印度基金、JF 東協基金、JF 南韓基金、JF 泰國基金、JF 太平洋科技基金、JF 日本小型企業(日圓)基金、JF 澳洲基金、JF 國際債券及貨幣基金、JF 馬來西亞基金、JF 貨幣基金－港元與 JF 菲律賓基金時，基金公司將收取每受益單位淨值百分之零點五作為贖回費用，故其基金之買賣價格將有所不同。

註四：計價貨幣依發行時連結之結構型債券而定。

註五：全球精選投資帳戶係全權委託亞太全球證券投資顧問公司之專業經營團隊進行資產運用，主要投資於經過其精選且為證期會核准之國內外共同基金或基金連結標的，亞太全球證券投資顧問公司會收取「投資標的」經理費及保管費，每一保單年度以不超過下列數值為限。此項費用反映於投資標的單位價值中，要保人無需另外負擔。有關全球精選投資帳戶之詳細資料請參閱本公司當時之商品說明書。

| 「投資標的」名稱    | 「投資標的」經理費 | 「投資標的」保管費 |
|-------------|-----------|-----------|
| 全球精選積極型投資帳戶 | 1.5%      | 0.1%      |
| 全球精選穩健型投資帳戶 | 1.2%      | 0.1%      |
| 全球精選保守型投資帳戶 | 0.3%      | 0.1%      |

【附件二之一】臺灣壽險業第四回經驗生命表死亡率的百分之百

(單位：萬分之一)

| 到達年齡 | 男性      | 女性      |
|------|---------|---------|
| 0    | 57.3000 | 52.4000 |
| 1    | 9.6800  | 9.0400  |
| 2    | 7.5200  | 6.2400  |
| 3    | 5.8400  | 4.4000  |
| 4    | 4.7200  | 3.2800  |
| 5    | 3.9200  | 2.8000  |
| 6    | 3.5200  | 2.4800  |
| 7    | 3.2800  | 2.2400  |
| 8    | 3.2000  | 2.0800  |
| 9    | 3.1200  | 1.9200  |
| 10   | 2.9600  | 1.9200  |
| 11   | 2.8800  | 1.9200  |
| 12   | 3.0400  | 2.1600  |
| 13   | 3.7600  | 2.4800  |
| 14   | 5.2800  | 2.9600  |
| 15   | 7.5200  | 3.4400  |
| 16   | 10.1600 | 3.9200  |
| 17   | 12.6000 | 4.3300  |
| 18   | 12.8800 | 4.8100  |
| 19   | 13.0500 | 5.1300  |
| 20   | 13.1300 | 5.3000  |
| 21   | 13.1500 | 5.3600  |
| 22   | 13.1200 | 5.3300  |
| 23   | 13.0700 | 5.2500  |
| 24   | 13.0100 | 5.1500  |
| 25   | 12.9800 | 5.0700  |
| 26   | 12.9900 | 5.0400  |
| 27   | 13.0700 | 5.1000  |
| 28   | 13.2300 | 5.2700  |
| 29   | 13.5100 | 5.5600  |
| 30   | 13.9300 | 5.9300  |
| 31   | 14.5200 | 6.3800  |
| 32   | 15.3000 | 6.8800  |
| 33   | 16.3000 | 7.4300  |
| 34   | 17.5000 | 8.0200  |
| 35   | 18.8600 | 8.6500  |
| 36   | 20.3700 | 9.3100  |
| 37   | 22.0100 | 10.0100 |
| 38   | 23.7400 | 10.7400 |
| 39   | 25.6000 | 11.5300 |
| 40   | 27.6100 | 12.4000 |
| 41   | 29.8000 | 13.3600 |
| 42   | 32.2000 | 14.4500 |
| 43   | 34.8400 | 15.6700 |
| 44   | 37.7100 | 17.0700 |
| 45   | 40.8400 | 18.6700 |
| 46   | 44.2100 | 20.4900 |
| 47   | 47.8400 | 22.5700 |
| 48   | 51.7500 | 24.9100 |
| 49   | 55.9700 | 27.4700 |
| 50   | 60.5600 | 30.1700 |
| 51   | 65.5800 | 32.9400 |
| 52   | 71.0800 | 35.7200 |
| 53   | 77.1300 | 38.4800 |
| 54   | 83.8000 | 41.4000 |
| 55   | 91.1800 | 44.6900 |

| 到達年齡 | 男性         | 女性         |
|------|------------|------------|
| 56   | 99.3500    | 48.5800    |
| 57   | 108.3900   | 53.2700    |
| 58   | 118.4000   | 58.9500    |
| 59   | 129.4400   | 65.5400    |
| 60   | 141.5800   | 72.9300    |
| 61   | 154.8800   | 81.0100    |
| 62   | 169.4200   | 89.6600    |
| 63   | 185.2800   | 98.8200    |
| 64   | 202.6100   | 108.6700   |
| 65   | 221.5700   | 119.4200   |
| 66   | 242.3300   | 131.3000   |
| 67   | 265.0500   | 144.5300   |
| 68   | 289.9200   | 159.3400   |
| 69   | 317.1500   | 175.8800   |
| 70   | 346.9800   | 194.3100   |
| 71   | 379.6300   | 214.7800   |
| 72   | 415.3500   | 237.4500   |
| 73   | 454.3600   | 262.4800   |
| 74   | 497.0100   | 290.1600   |
| 75   | 543.6300   | 320.7900   |
| 76   | 594.5700   | 354.6600   |
| 77   | 650.1600   | 392.0800   |
| 78   | 710.7700   | 433.3700   |
| 79   | 776.8600   | 478.9600   |
| 80   | 848.8900   | 529.3200   |
| 81   | 927.3400   | 584.8900   |
| 82   | 1012.6800  | 646.1400   |
| 83   | 1105.4200  | 713.5600   |
| 84   | 1206.1100  | 787.7800   |
| 85   | 1315.3600  | 869.4600   |
| 86   | 1433.7500  | 959.2500   |
| 87   | 1561.8800  | 1057.8300  |
| 88   | 1700.3300  | 1165.8700  |
| 89   | 1849.7000  | 1284.1900  |
| 90   | 2010.5500  | 1413.6100  |
| 91   | 2183.4800  | 1554.9700  |
| 92   | 2369.0700  | 1709.0900  |
| 93   | 2567.8300  | 1876.8100  |
| 94   | 2780.0300  | 2058.8500  |
| 95   | 3005.8900  | 2255.9600  |
| 96   | 3245.5900  | 2468.8700  |
| 97   | 3499.3600  | 2698.3000  |
| 98   | 3767.1700  | 2944.8000  |
| 99   | 4048.1500  | 3208.0900  |
| 100  | 4341.1900  | 3487.7100  |
| 101  | 4645.2000  | 3783.1900  |
| 102  | 4959.0800  | 4094.0600  |
| 103  | 5281.7500  | 4419.8700  |
| 104  | 5612.2500  | 4760.3000  |
| 105  | 5949.6700  | 5115.0100  |
| 106  | 6293.0700  | 5483.7100  |
| 107  | 6641.5200  | 5866.0700  |
| 108  | 6980.7800  | 6245.5800  |
| 109  | 7313.8400  | 6625.8800  |
| 110  | 10000.0000 | 10000.0000 |
| -    |            |            |

### 【附件三】投資標的說明

#### 一、投資標的簡介：

##### (一) 共同基金、基金連結標的、貨幣帳戶與結構型債券之簡介

| 類別   | 分類    | 投資標的名稱  | 投資標的幣別 | 是否有單位價值 | 是否有配息 | 投資標的發行機構          |
|------|-------|---|--------|---------|-------|-------------------|
| 共同基金 | 海外股票型 | 聯博－全球成長趨勢基金 A 股美元                             | 美元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司          |
|      |       | 聯博－國際科技基金 A 股美元                               | 美元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司          |
|      |       | 聯博－國際醫療基金 A 股美元                               | 美元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司          |
|      |       | 聯博－全球價值型基金 A 股美元                              | 美元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司          |
|      |       | 聯博－新興市場成長基金 A 股美元                             | 美元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司          |
|      |       | 聯博－歐洲價值型基金 A 股歐元                              | 歐元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司          |
|      |       | 聯博－全球複合型股票基金 A 股美元                            | 美元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司          |
|      |       | 富蘭克林坦伯頓成長基金 A 股                               | 美元     | 有       | 有     | 富蘭克林坦伯頓基金集團       |
|      |       | 百利達美國基金 L 股                                   | 美元     | 有       | 無     | 法國巴黎資產管理盧森堡公司     |
|      |       | 百利達日本小型公司基金 L 股                               | 日圓     | 有       | 無     | 法國巴黎資產管理盧森堡公司     |
|      |       | 瑞銀(盧森堡)美國小型股票基金                               | 美元     | 有       | 無     | 瑞銀股票基金管理股份有限公司    |
|      |       | 瑞銀(盧森堡)歐洲中型股票基金                               | 歐元     | 有       | 無     | 瑞銀股票基金管理股份有限公司    |
|      |       | 德盛德利全球生物科技基金                                  | 歐元     | 有       | 有     | 德利投資信託公司          |
|      |       | 德盛德利西葡基金                                      | 歐元     | 有       | 無     | 德利投資信託公司          |
|      |       | 德盛德利全球資源產業基金                                  | 歐元     | 有       | 有     | 德利投資信託公司          |
|      |       | 德盛德利德國基金                                      | 歐元     | 有       | 無     | 德利投資信託公司          |
|      |       | 德盛安聯目標傘型基金之目標 2030 基金                         | 新台幣    | 有       | 無     | 德盛安聯證券投資信託股份有限公司  |
|      |       | 霸菱東歐基金美元                                      | 美元     | 有       | 無     | 霸菱資產管理公司          |
|      |       | 霸菱拉丁美洲基金美元                                    | 美元     | 有       | 有     | 霸菱資產管理公司          |
|      |       | 霸菱全球資源基金美元                                    | 美元     | 有       | 有     | 霸菱資產管理公司          |
|      |       | 霸菱歐寶基金美元                                      | 美元     | 有       | 有     | 霸菱資產管理公司          |
|      |       | 富達基金－富達目標基金 2020                              | 美元     | 有       | 無     | 富達投資集團            |
|      |       | 富達基金－日本基金                                     | 日圓     | 有       | 無     | 富達投資集團            |
|      |       | 富達基金－歐洲基金                                     | 歐元     | 有       | 有     | 富達投資集團            |
|      |       | 摩根富林明 JF 新興日本基金                               | 新台幣    | 有       | 無     | 摩根富林明證券投資信託股份有限公司 |
|      |       | 摩根富林明 JF 亞洲基金                                 | 新台幣    | 有       | 無     | 摩根富林明證券投資信託股份有限公司 |
|      |       | 摩根富林明 JF 龍揚基金                                 | 新台幣    | 有       | 無     | 摩根富林明證券投資信託股份有限公司 |
|      |       | 摩根富林明全球 α 基金                                  | 新台幣    | 有       | 無     | 摩根富林明證券投資信託股份有限公司 |
|      |       | 摩根富林明新興 35 基金                                 | 新台幣    | 有       | 無     | 摩根富林明證券投資信託股份有限公司 |
|      |       | 摩根富林明歐洲策略價值基金－摩根富林明歐洲策略價值(歐元)－A 股(分派)         | 歐元     | 有       | 有     | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司 |
|      |       | 摩根富林明新興中東基金－摩根富林明新興中東(美元)－A 股(分派)             | 美元     | 有       | 有     | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司 |
|      |       | 摩根富林明東歐基金－JF 東歐(歐元)－A 股(分派)                   | 歐元     | 有       | 有     | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司 |
|      |       | 摩根富林明歐元股票基金－JF 歐元區(美元)－A 股(分派)                | 美元     | 有       | 有     | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司 |
|      |       | 摩根富林明新興歐洲、中東及非洲基金－摩根富林明新興歐洲、中東及非洲(美元)－A 股(分派) | 美元     | 有       | 有     | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司 |
|      |       | 摩根富林明基金－摩根富林明 JF 大中華基金                        | 美元     | 有       | 無     | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司 |
|      |       | 保德信亞太基金                                       | 新台幣    | 有       | 無     | 保德信證券投資信託股份有限公司   |
|      |       | JF 太平洋科技基金                                    | 美元     | 有       | 無     | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司   |
|      |       | JF 日本小型企業(日圓)基金                               | 日圓     | 有       | 無     | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司   |
|      |       | JF 印度基金                                       | 美元     | 有       | 無     | JF 印度管理有限公司       |
|      |       | JF 東協基金                                       | 美元     | 有       | 有     | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司   |
|      |       | JF 南韓基金                                       | 美元     | 有       | 有     | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司   |
|      |       | JF 泰國基金                                       | 美元     | 有       | 有     | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司   |

| 類別 | 分類 | 投資標的名稱                          | 投資標的幣別 | 是否有單位價值 | 是否有配息 | 投資標的發行機構         |
|----|----|---------------------------------|--------|---------|-------|------------------|
|    |    | JF 澳洲基金                         | 美元     | 有       | 有     | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司  |
|    |    | JF 馬來西亞基金                       | 美元     | 有       | 有     | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司  |
|    |    | JF 菲律賓基金                        | 美元     | 有       | 有     | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司  |
|    |    | 元大亞太成長基金                        | 新台幣    | 有       | 無     | 元大證券投資信託股份有限公司   |
|    |    | 元大泛歐成長基金                        | 新台幣    | 有       | 無     | 元大證券投資信託股份有限公司   |
|    |    | 瑞士安勤黃金基金 AA                     | 美元     | 有       | 無     | 瑞士安勤基金管理有限公司     |
|    |    | 友邦環球基金－友邦環球股票基金 A               | 美元     | 有       | 有     | 友邦基金管理公司         |
|    |    | 友邦環球基金－友邦環球股票價值基金 A             | 美元     | 有       | 有     | 友邦基金管理公司         |
|    |    | 天達環球能源基金 C 股                    | 美元     | 有       | 無     | 天達資產管理根西島有限公司    |
|    |    | 天達環球動力基金 C 股                    | 美元     | 有       | 有     | 天達資產管理根西島有限公司    |
|    |    | 天達環球策略股票基金 C 股                  | 美元     | 有       | 無     | 天達資產管理根西島有限公司    |
|    |    | 天達環球黃金基金 C 股                    | 美元     | 有       | 無     | 天達資產管理根西島有限公司    |
|    |    | 台灣工銀北美收益資產證券化基金                 | 新台幣    | 有       | 無     | 台灣工銀證券投資信託股份有限公司 |
|    |    | 安本環球－亞太股票基金                     | 美元     | 有       | 無     | 安本資產管理公司         |
|    |    | 安泰 ING 全球高股息基金累積型               | 新台幣    | 有       | 無     | 安泰證券投資信託股份有限公司   |
|    |    | 亨德森遠見全球科技基金                     | 美元     | 有       | 無     | 亨德森資產管理公司        |
|    |    | 亨德森遠見泛歐小型公司基金                   | 歐元     | 有       | 無     | 亨德森資產管理公司        |
|    |    | 亨德森遠見泛歐股票基金                     | 歐元     | 有       | 無     | 亨德森資產管理公司        |
|    |    | 保德信中型成長基金                       | 美元     | 有       | 無     | 保德信投資管理公司        |
|    |    | 保德信全球醫療生化基金                     | 新台幣    | 有       | 無     | 保德信證券投資信託股份有限公司  |
|    |    | 貝萊德世界金融基金 A2 美元                 | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 貝萊德世界能源基金 A2 美元                 | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 貝萊德世界健康科學基金 A2 美元               | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 貝萊德世界黃金基金 A2 美元                 | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 貝萊德世界礦業基金 A2 美元                 | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 貝萊德拉丁美洲基金 A2 美元                 | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 貝萊德新能源基金 A2 美元                  | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 貝萊德新興市場基金 A2 美元                 | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 貝萊德新興歐洲基金 A2 美元                 | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 貝萊德歐元市場基金 A2 歐元                 | 歐元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 貝萊德歐洲特別時機基金 A2 美元               | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 貝萊德歐洲基金 A2 歐元                   | 歐元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司       |
|    |    | 富達基金－全球聚焦基金                     | 美元     | 有       | 無     | 富達投資集團           |
|    |    | 富達基金－印度聚焦基金                     | 美元     | 有       | 無     | 富達投資集團           |
|    |    | 富達基金－世界基金                       | 歐元     | 有       | 無     | 富達投資集團           |
|    |    | 富達基金－北歐基金                       | 瑞典克朗   | 有       | 有     | 富達投資集團           |
|    |    | 富達基金－全球金融服務基金                   | 歐元     | 有       | 有     | 富達投資集團           |
|    |    | 富達基金－南歐基金                       | 歐元     | 有       | 有     | 富達投資集團           |
|    |    | 富達基金－星馬泰基金                      | 美元     | 有       | 無     | 富達投資集團           |
|    |    | 富達基金－國際基金                       | 美元     | 有       | 無     | 富達投資集團           |
|    |    | 富達基金－歐洲小型企業基金                   | 歐元     | 有       | 無     | 富達投資集團           |
|    |    | 富達基金－歐洲進取基金                     | 歐元     | 有       | 有     | 富達投資集團           |
|    |    | 富達基金－印尼基金                       | 美元     | 有       | 有     | 富達投資集團           |
|    |    | 富蘭克林坦伯頓世界基金 A 股                 | 美元     | 有       | 有     | 富蘭克林坦伯頓基金集團      |
|    |    | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－互利歐洲基金歐元 A(acc)股  | 歐元     | 有       | 無     | 富蘭克林坦伯頓基金集團      |
|    |    | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－全球基金美元 A(Ydis)股   | 美元     | 有       | 有     | 富蘭克林坦伯頓基金集團      |
|    |    | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－拉丁美洲基金美元 A(Ydis)股 | 美元     | 有       | 有     | 富蘭克林坦伯頓基金集團      |
|    |    | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－金磚四國基金美元 A(acc)股  | 美元     | 有       | 無     | 富蘭克林坦伯頓基金集團      |

| 類別 | 分類    | 投資標的名稱                                | 投資標的幣別 | 是否有單位價值 | 是否有配息 | 投資標的發行機構         |
|----|-------|---------------------------------------|--------|---------|-------|------------------|
|    |       | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—大中華基金美元 A(acc)股         | 美元     | 有       | 無     | 富蘭克林坦伯頓基金集團      |
|    |       | 瑞銀(盧森堡)生化股票基金                         | 美元     | 有       | 無     | 瑞銀股票基金管理股份有限公司   |
|    |       | 德盛日本基金                                | 美元     | 有       | 無     | 德盛安聯資產管理公司       |
|    |       | 德盛金磚四國基金—AT 累積類股(美元)                  | 美元     | 有       | 無     | 德盛安聯資產管理公司       |
|    |       | 施羅德環球基金系列—日本小型公司 A1 類股份—累積單位          | 日圓     | 有       | 無     | 施羅德投資管理有限公司      |
|    |       | 施羅德環球基金系列—日本股票 A1 類股份—累積單位            | 日圓     | 有       | 無     | 施羅德投資管理有限公司      |
|    |       | 施羅德環球基金系列—拉丁美洲 A1 類股份—累積單位            | 美元     | 有       | 無     | 施羅德投資管理有限公司      |
|    |       | 施羅德環球基金系列—新興亞洲 A1 類股份—累積單位            | 美元     | 有       | 無     | 施羅德投資管理有限公司      |
|    |       | 施羅德環球基金系列—歐元動力增長 A1 類股份—累積單位          | 歐元     | 有       | 無     | 施羅德投資管理有限公司      |
|    |       | 施羅德環球基金系列—歐洲小型公司 A1 類股份—累積單位          | 歐元     | 有       | 無     | 施羅德投資管理有限公司      |
|    |       | 施羅德環球基金系列—金磚四國 A1 類股份—累積單位            | 美元     | 有       | 無     | 施羅德投資管理有限公司      |
|    |       | 駿利資產管理基金—駿利美國 20 基金 A USD             | 美元     | 有       | 無     | 駿利資產管理國際有限公司     |
|    |       | 駿利資產管理基金—駿利環球生命科技基金 A 美元累計            | 美元     | 有       | 無     | 駿利資產管理國際有限公司     |
|    |       | 駿利資產管理基金—駿利美國各型股增長基金 A 美元累計           | 美元     | 有       | 無     | 駿利資產管理國際有限公司     |
|    |       | 駿利資產管理基金—駿利環球科技基金 A 美元累計              | 美元     | 有       | 無     | 駿利資產管理國際有限公司     |
|    |       | 華南永昌全球基礎建設基金(不配息)                     | 新台幣    | 有       | 無     | 華南永昌證券投資信託股份有限公司 |
|    |       | 華南永昌全球精品基金                            | 新台幣    | 有       | 無     | 華南永昌證券投資信託股份有限公司 |
|    |       | 群益新興金鑽基金                              | 新台幣    | 有       | 無     | 群益證券投資信託股份有限公司   |
|    |       | MFS 全盛國際研究基金 A1(美元)                   | 美元     | 有       | 無     | MFS 資產管理公司       |
|    |       | 木星生態基金美元                              | 美元     | 有       | 有     | 木星單位信託管理有限公司     |
|    |       | 木星全球管理基金美元                            | 美元     | 有       | 有     | 木星單位信託管理有限公司     |
|    |       | 木星金融機會基金美元                            | 美元     | 有       | 有     | 木星單位信託管理有限公司     |
|    |       | 木星新興歐洲機會基金美元                          | 美元     | 有       | 有     | 木星單位信託管理有限公司     |
|    |       | 木星歐洲特別時機基金美元                          | 美元     | 有       | 有     | 木星單位信託管理有限公司     |
|    |       | 英國保誠集團 M&G 投資基金(1)英國保誠集團 M&G 全球民生基礎基金 | 歐元     | 有       | 無     | 保誠資產管理(新加坡)有限公司  |
|    |       | 摩根士丹利拉丁美洲股票基金 A                       | 美元     | 有       | 無     | 摩根士丹利投資管理有限公司    |
|    |       | 摩根士丹利日本價值股票基金 A                       | 日圓     | 有       | 無     | 摩根士丹利投資管理有限公司    |
|    |       | 摩根士丹利歐洲、中東及非洲新興股票基金 A                 | 歐元     | 有       | 無     | 摩根士丹利投資管理有限公司    |
|    |       | 德意志 DWS Invest 全球神農 A2                | 美元     | 有       | 無     | 德意志投資(股)公司       |
|    |       | 德意志 DWS Invest 歐洲股票 LC                | 歐元     | 有       | 無     | 德意志投資(股)公司       |
|    | 海外債券型 | 聯博—短期債券基金 A2 股美元                      | 美元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司         |
|    | 海外債券型 | 聯博—全球債券基金 A2 股美元                      | 美元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司         |
|    | 海外債券型 | 聯博—美國收益基金 A2 股美元                      | 美元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司         |
|    | 海外債券型 | 聯博—全球高收益債券基金 A2 股美元                   | 美元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司         |
|    | 海外債券型 | 聯博—歐洲收益基金 A2 股歐元                      | 歐元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司         |
|    | 海外債券型 | 百利達亞洲可換股債券基金 L 股                      | 美元     | 有       | 無     | 法國巴黎資產管理盧森堡公司    |

| 類別 | 分類    | 投資標的名稱                              | 投資標的幣別 | 是否有單位價值 | 是否有配息 | 投資標的發行機構          |
|----|-------|-------------------------------------|--------|---------|-------|-------------------|
|    |       | 瑞銀(盧森堡)美元債券基金                       | 美元     | 有       | 無     | 瑞銀債券基金管理股份有限公司    |
|    |       | 德盛德利國際債券基金                          | 歐元     | 有       | 有     | 德利投資信託公司          |
|    |       | 德盛德利歐洲債券基金                          | 歐元     | 有       | 有     | 德利投資信託公司          |
|    |       | 霸菱高收益債券基金—美元季配                      | 美元     | 有       | 有     | 霸菱資產管理公司          |
|    |       | JF 國際債券及貨幣基金                        | 美元     | 有       | 有     | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司   |
|    |       | 貝萊德歐元優質債券基金 A2 歐元                   | 歐元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司        |
|    |       | 創利德(盧森堡)—全球高收益與新興市場債券基金(歐元)         | 歐元     | 有       | 無     | 創利德管理(盧森堡)有限公司    |
|    |       | 富達基金—美元高收益基金                        | 美元     | 有       | 有     | 富達投資集團            |
|    |       | 富達基金—英鎊債券基金                         | 英鎊     | 有       | 有     | 富達投資集團            |
|    |       | 富達基金—國際債券基金                         | 美元     | 有       | 有     | 富達投資集團            |
|    |       | 富達基金—歐洲高收益基金                        | 歐元     | 有       | 有     | 富達投資集團            |
|    |       | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—公司債基金美元 A(Mdis)股      | 美元     | 有       | 有     | 富蘭克林坦伯頓基金集團       |
|    |       | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—全球債券基金美元 A(Mdis)股     | 美元     | 有       | 有     | 富蘭克林坦伯頓基金集團       |
|    |       | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—美國政府基金美元 A(Mdis)股     | 美元     | 有       | 有     | 富蘭克林坦伯頓基金集團       |
|    |       | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—新興國家固定收益基金美元 A(Qdis)股 | 美元     | 有       | 有     | 富蘭克林坦伯頓基金集團       |
|    |       | 瑞銀(盧森堡)新興市場債券基金                     | 美元     | 有       | 無     | 瑞銀新興市場基金管理股份有限公司  |
|    |       | 瑞銀(盧森堡)歐元債券基金                       | 歐元     | 有       | 無     | 瑞銀債券基金管理股份有限公司    |
|    |       | 瑞銀(盧森堡)策略基金—固定收益型(美元)               | 美元     | 有       | 無     | 瑞銀策略基金管理股份有限公司    |
|    |       | 瑞銀(盧森堡)策略基金—固定收益型(歐元)               | 歐元     | 有       | 無     | 瑞銀策略基金管理股份有限公司    |
|    |       | 駿利資產管理基金—駿利美國高收益基金 A2 USD           | 美元     | 有       | 無     | 駿利資產管理國際有限公司      |
|    |       | 施羅德環球基金系列—亞洲債券 A1 類股份—累積單位          | 美元     | 有       | 無     | 施羅德投資管理有限公司       |
|    |       | 施羅德環球基金系列—美元債券 A1 類股份—累積單位          | 美元     | 有       | 無     | 施羅德投資管理有限公司       |
|    |       | 施羅德環球基金系列—新興市場債券 A1 類股份—累積單位        | 美元     | 有       | 無     | 施羅德投資管理有限公司       |
|    |       | 施羅德環球基金系列—環球債券 A1 類股份—累積單位          | 美元     | 有       | 無     | 施羅德投資管理有限公司       |
|    |       | 天達環球策略收益基金 C 股                      | 美元     | 有       | 有     | 天達資產管理根西島有限公司     |
|    |       | 華南永昌全球短期固定收益基金                      | 新台幣    | 有       | 無     | 華南永昌證券投資信託股份有限公司  |
|    |       | MFS 全盛通脹調整債券基金 A1(美元)               | 美元     | 有       | 無     | MFS 資產管理公司        |
|    | 海外平衡型 | 德盛東方入息基金—A 類股份                      | 美元     | 有       | 有     | 德盛安聯資產管理公司        |
|    |       | 德盛安聯目標傘型基金之目標 2015 基金               | 新台幣    | 有       | 無     | 德盛安聯證券投資信託股份有限公司  |
|    |       | 德盛安聯目標傘型基金之目標 2020 基金               | 新台幣    | 有       | 無     | 德盛安聯證券投資信託股份有限公司  |
|    |       | 第一金歐洲動力平衡證券投資信託基金                   | 新台幣    | 有       | 無     | 第一金證券投資信託股份有限公司   |
|    |       | 貝萊德環球資產配置基金 A2 美元                   | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司        |
|    |       | 貝萊德策略配置基金 A2 美元                     | 美元     | 有       | 無     | 貝萊德(盧森堡)公司        |
|    |       | 瑞銀(盧森堡)全球戰略配置精選基金(美元)               | 美元     | 有       | 無     | 瑞銀(盧森堡)精選管理基金公司   |
|    |       | 聯博—全球平衡型基金 A 股美元                    | 美元     | 有       | 無     | 聯博資產管理公司          |
|    |       | 富達基金—富達目標基金 2010                    | 美元     | 有       | 無     | 富達投資集團            |
|    |       | 富達基金—富達歐元目標 TM 基金 2025              | 歐元     | 有       | 有     | 富達投資集團            |
|    |       | 富達基金—富達歐元目標 TM 基金 2030              | 歐元     | 有       | 有     | 富達投資集團            |
|    |       | 群益亞太新趨勢平衡基金                         | 新台幣    | 有       | 無     | 群益證券投資信託股份有限公司    |
|    |       | 摩根富林明全球平衡基金                         | 新台幣    | 有       | 無     | 摩根富林明證券投資信託股份有限公司 |
| 海  |       | 瑞銀(盧森堡)歐元基金                         | 歐元     | 有       | 無     | 瑞銀貨幣市場基金管理股份有限公司  |

| 類別          | 分類     | 投資標的名稱   | 投資標的幣別 | 是否有單位價值 | 是否有配息          | 投資標的發行機構                                   |
|-------------|--------|--|--------|---------|----------------|--|
|             | 外幣型    | 瑞銀(盧森堡)美元基金  | 美元     | 有       | 無              | 瑞銀貨幣市場基金管理股份有限公司                           |
|             |        | 瑞銀(盧森堡)澳幣基金  | 澳幣     | 有       | 無              | 瑞銀貨幣市場基金管理股份有限公司                           |
|             |        | JF 貨幣基金—港元   | 港幣     | 有       | 有              | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                            |
|             |        | 天達理財貨幣基金 C 股   | 美元     | 有       | 有              | 天達資產管理根西島有限公司                              |
|             |        | 百利達短期英鎊基金 L 股  | 英鎊     | 有       | 有              | 法國巴黎資產管理盧森堡公司                              |
|             |        | 富達基金—美元現金基金  | 美元     | 有       | 有              | 富達投資集團                                     |
|             | 海外組合型  | 台灣工銀全球增長組合基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 台灣工銀證券投資信託股份有限公司                           |
|             |        | 安泰 ING 鑫平衡組合基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 安泰證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 群益多重收益組合基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 群益證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 摩根富林明 JF 安家理財基金  | 新台幣    | 有       | 無              | 摩根富林明證券投資信託股份有限公司                          |
|             | 國內股票型  | 保德信金滿意基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 保德信證券投資信託股份有限公司                            |
|             |        | 群益馬拉松基金  | 新台幣    | 有       | 無              | 群益證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 日盛上選基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 日盛證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 第一金電子證券投資信託基金  | 新台幣    | 有       | 無              | 第一金證券投資信託股份有限公司                            |
|             |        | 第一金大中華證券投資信託基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 第一金證券投資信託股份有限公司                            |
|             |        | 摩根富林明 JF 價值成長基金  | 新台幣    | 有       | 無              | 摩根富林明證券投資信託股份有限公司                          |
|             |        | 元大多福基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 元大證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 元大店頭基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 元大證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 元大新主流基金  | 新台幣    | 有       | 無              | 元大證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 台灣工銀 2000 高科技基金  | 新台幣    | 有       | 無              | 台灣工銀證券投資信託股份有限公司                           |
|             |        | 台灣工銀大眾基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 台灣工銀證券投資信託股份有限公司                           |
|             |        | 華南永昌永昌基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 華南永昌證券投資信託股份有限公司                           |
|             |        | 群益創新科技基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 群益證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 復華高成長基金  | 新台幣    | 有       | 無              | 復華證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 復華數位經濟基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 復華證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 復華中小精選基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 復華證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 永豐永豐基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 永豐證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 永豐中小基金   | 新台幣    | 有       | 無              | 永豐證券投資信託股份有限公司                             |
|             | 國內債券型  | 保德信瑞騰基金  | 新台幣    | 有       | 無              | 保德信證券投資信託股份有限公司                            |
|             |        | 保德信債券基金  | 新台幣    | 有       | 無              | 保德信證券投資信託股份有限公司                            |
|             |        | 安泰 ING 債券基金  | 新台幣    | 有       | 無              | 安泰證券投資信託股份有限公司                             |
|             | 國內平衡型  | 摩根富林明 JF 平衡基金  | 新台幣    | 有       | 無              | 摩根富林明證券投資信託股份有限公司                          |
| 群益安家基金      |        | 新台幣  | 有      | 無       | 群益證券投資信託股份有限公司 |  |
| 群益真善美基金     |        | 新台幣  | 有      | 無       | 群益證券投資信託股份有限公司 |  |
| 復華神盾基金      |        | 新台幣  | 有      | 無       | 復華證券投資信託股份有限公司 |  |
| 國內貨幣型       | 群益安穩基金 | 新台幣  | 有      | 無       | 群益證券投資信託股份有限公司 |  |
|             | 復華債券基金 | 新台幣  | 有      | 無       | 復華證券投資信託股份有限公司 |  |
| 基金連結標的(註 1) | 股票型    | 標準普爾 500 指數基金<br>(iShares S&P 500 Index Fund)          | 美元     | 有       | 有              | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors) |
|             |        | 那斯達克 100 指數基金<br>(PowerShares QQQ Nasdaq 100)          | 美元     | 有       | 有              | PowerShares Capital Management LLC         |
|             |        | 標準普爾全球 100 指數基金<br>(iShares S&P Global 100 Index Fund) | 美元     | 有       | 有              | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors) |
|             |        | 寶來台灣卓越 50 指數基金   | 新台幣    | 有       | 有              | 寶來證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 寶來台灣中型 100 基金  | 新台幣    | 有       | 有              | 寶來證券投資信託股份有限公司                             |
|             |        | 標準普爾歐洲 350 指數基金<br>(iShares S&P Europe 350 Index Fund) | 美元     | 有       | 有              | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors) |

| 類別    | 分類   | 投資標的名稱   | 投資標的幣別     | 是否有單位價值 | 是否有配息  | 投資標的發行機構                                     |
|-------|------|--|------------|---------|--------|--|
|       |      | 泛太平洋(不包含日本)指數基金<br>(iShares MSCI Pacific ex-Japan Index)                 | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | MSCI 日本指數基金<br>(iShares MSCI Japan Index Fund)                           | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | MSCI 新興市場指數基金<br>(iShares MSCI Emerging Markets Index)                   | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | 道瓊歐盟 50 指數基金<br>(iShares DJ EURO Stoxx 50 (DE))                          | 歐元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | 道瓊原物料指數基金<br>(iShares Dow Jones U.S. Basic Materials Sector Index Fund)  | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | 羅素 2000 指數基金<br>(iShares Russell 2000 Index Fund)                        | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | 全球水資源指數基金<br>(POWERSHARES GLOBAL WATER PORTFOLIO)                        | 美元         | 有       | 有      | PowerShares Capital Management LLC           |
|       |      | 道瓊工業指數基金<br>(DIAMONDS Trust Series I)                                    | 美元         | 有       | 有      | 道富環球投資管理公司<br>(State Street Global Advisors) |
|       |      | 標準普爾中國指數基金<br>(SPDR S&P China ETF)                                       | 美元         | 有       | 有      | 道富環球投資管理公司<br>(State Street Global Advisors) |
|       |      | 德國 DAX 指數基金<br>(iShares DAX (DE))  | 歐元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | 放空型那斯達克 100 指數基金<br>(Short QQQ ProShares)                                | 美元         | 有       | 有      | ProShares Advisors LLC                       |
|       |      | 放空型道瓊工業指數基金<br>(Short Dow30 ProShares)                                   | 美元         | 有       | 有      | ProShares Advisors LLC                       |
|       |      | 放空型標準普爾 500 指數基金<br>(Short S&P500 ProShares)                             | 美元         | 有       | 有      | ProShares Advisors LLC                       |
|       |      | 放空型 MSCI 新興市場指數基金<br>(Short MSCI Emerging Markets ProShares)             | 美元         | 有       | 有      | ProShares Advisors LLC                       |
|       |      | MSCI 巴西指數基金<br>(iShares MSCI Brazil Index Fund)                          | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | MSCI 金磚四國指數基金<br>(iShares MSCI BRIC Index Fund)                          | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | 富時新華中國 25 指數基金<br>(iShares FTSE/Xinhua China 25 Index Fund)              | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | 標準普爾亞洲 50 指數基金<br>(iShares S&P Asia 50 Index Fund)                       | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       | 債券型  | 美國 1-3 年政府票券指數基金<br>(iShares Barclays 1-3 Year Treasury Bond Fund)       | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | 美國 7-10 年政府債券指數基金<br>(iShares Barclays 7-10 Year Treasury Bond Fund)     | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       |      | 美國投資級公司債券指數基金<br>(iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond Fund) | 美元         | 有       | 有      | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors)   |
|       | 貨幣帳戶 | 新台幣貨幣帳戶  | 新台幣        | 無(註 2)  | 無      | 全球人壽保險股份有限公司                                 |
|       |      | 日圓貨幣帳戶   | 日圓         | 無(註 2)  | 無      | 全球人壽保險股份有限公司                                 |
|       |      | 美元貨幣帳戶   | 美元         | 無(註 2)  | 無      | 全球人壽保險股份有限公司                                 |
|       |      | 歐元貨幣帳戶   | 歐元         | 無(註 2)  | 無      | 全球人壽保險股份有限公司                                 |
|       |      | 港幣貨幣帳戶   | 港幣         | 無(註 2)  | 無      | 全球人壽保險股份有限公司                                 |
|       |      | 澳幣貨幣帳戶   | 澳幣         | 無(註 2)  | 無      | 全球人壽保險股份有限公司                                 |
|       |      | 紐幣貨幣帳戶   | 紐幣         | 無(註 2)  | 無      | 全球人壽保險股份有限公司                                 |
| 結構型債券 |      | 結構型債券(註 3)   | 美元、<br>歐元、 | 無       | 依本公司當時 | 結構型債券  |

| 類別 | 分類 | 投資標的名稱 | 投資標的幣別                          | 是否有單位價值 | 是否有配息                  | 投資標的發行機構 |
|----|----|--------|---------------------------------|---------|------------------------|----------|
|    |    |        | 英鎊、<br>港幣、<br>澳幣、<br>紐幣、<br>日圓等 |         | 提供之<br>結構型<br>債券而<br>定 |          |

註1：基金連結標的係指指數股票型證券投資信託基金受益憑證（Exchange Traded Funds, ETFs），有關基金連結標的之詳細資料請參閱本公司當時之商品說明書。

註2：貨幣帳戶係指本公司提供予要保人選擇之「投資標的」，係以本公司每月第一個營業日宣告之利率計息，該利率保證期間為一個月，且不得低於0。

(1)貨幣帳戶宣告利率，係依該「利率參考機構」每月第一個營業日公告之該幣別之活期儲蓄存款年利率。

(2)上述貨幣帳戶之計息方式，係以宣告利率按單利方式逐日計算。前述「以單利方式逐日計算」，係以約定之宣告利率除以365作為每日單利計息之基準。

註3：有關結構型債券之詳細資料請參閱【附件四】結構型債券說明或本公司推出該結構型債券當時之商品說明書及結構型債券投資報酬與風險告知書。

(二) 全球精選投資帳戶之簡介

| 類別       | 投資標的名稱      | 投資標的幣別 | 是否有單位價值 | 是否有配息 | 投資標的可能投資共同基金及基金連結標的(註)<br>之所屬發行機構   |
|----------|-------------|--------|---------|-------|---|
| 全球精選投資帳戶 | 全球精選積極型投資帳戶 | 美元     | 有       | 無     | 法國巴黎資產管理盧森堡公司、ING 資產管理公司、富蘭克林坦伯頓基金集團、瑞銀股票基金管理股份有限公司、德利投資信託公司、霸菱資產管理公司、百達資產管理、比利時聯合資產管理公司、MFS 資產管理公司、木星單位信託管理有限公司、紐約銀行邁倫資產管理有限公司、摩根士丹利投資管理有限公司、德意志投資(股)公司、愛爾蘭安盛羅森堡有限公司、富達投資集團、摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司、JF 印度管理有限公司、摩根富林明基金(亞洲)有限公司、瑞士安勤基金管理有限公司、天達資產管理根西島有限公司、先機基金管理(愛爾蘭)有限公司、景順投資管理有限公司、美盛投資(歐洲)有限公司、歐義銳榮資產管理公司、PIMCO 資產管理、亨德森資產管理公司、保德信投資管理公司、安本資產管理公司、貝萊德(盧森堡)公司、德盛安聯資產管理公司、施羅德投資管理有限公司、駿利資產管理國際有限公司、瑞銀債券基金管理股份有限公司、瑞銀策略基金管理股份有限公司、瑞銀(盧森堡)精選管理基金公司、瑞銀貨幣市場基金管理股份有限公司、友邦基金管理公司、法興盧森堡公司、富通投資管理盧森堡公司、瑞銀新興市場基金管理股份有限公司、聯博資產管理公司、柏克萊國際投資管理公司(Barclays Global Investors)、PowerShares Capital Management LLC、道富環球投資管理公司(State Street Global Advisors)、ProShares Advisors LLC、Vanguard Group, Inc.、Rydex investments、Lyxor Asset Management SA、WisdomTree ETFs/USA、BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT SAS |
|          | 全球精選穩健型投資帳戶 | 美元     | 有       | 無     |   |
|          | 全球精選保守型投資帳戶 | 美元     | 有       | 無     |   |

註：全球精選投資帳戶可供投資的共同基金及基金連結標的如下表，本公司得報主管機關，新增或減少下表可供投資的共同基金及基金連結標的。

| 全球精選積極型投資帳戶、全球精選穩健型投資帳戶、全球精選保守型投資帳戶 |       |                                     |   |
|-------------------------------------|-------|-------------------------------------|---|
| 共同基金                                | 海外股票型 | ING(L)大中華投資基金                       | ING(L)日本投資基金                              |
|                                     |       | JF 太平洋小型企業基金                        | JF 太平洋科技基金                                |
|                                     |       | JF 太平洋證券基金                          | JF 日本小型企業(日圓)基金                           |
|                                     |       | JF 東協基金                             | KBC 全球上市新股基金                              |
|                                     |       | MFS 全盛全球股票基金                        | 瑞士安勤日本股票基金                                |
|                                     |       | 瑞士安勤黃金基金                            | 友邦環球基金—友邦日本中小型公司增值基金                      |
|                                     |       | 友邦環球基金—友邦日本新遠景基金                    | 友邦環球基金—友邦環球股票基金                           |
|                                     |       | 友邦環球基金—友邦環球股票價值基金                   | 天達環球能源基金                                  |
|                                     |       | 天達環球動力基金                            | 天達環球策略股票基金                                |
|                                     |       | 天達環球黃金基金                            | 木星全球管理基金                                  |
|                                     |       | 木星金融機會基金                            | 木星新興歐洲機會基金                                |
|                                     |       | 木星歐洲特別時機基金                          | 先機環球股票基金                                  |
|                                     |       | 安本環球日本股票基金                          | 安本環球世界股票基金                                |
|                                     |       | 安本環球—亞太股票基金                         | 安本環球—新興市場股票基金                             |
|                                     |       | 安盛羅森堡 Alpha 基金—安盛羅森堡日本大型企業 Alpha 基金 | 安盛羅森堡 Alpha 基金—安盛羅森堡亞太(日本除外)大型企業 Alpha 基金 |
|                                     |       | 百利達日本小型公司基金                         | 百利達全球股票基金                                 |
|                                     |       | 百利達全球資源基金                           | 百利達拉丁美洲基金                                 |
|                                     |       | 百利達美國基金                             | 百利達新興市場基金                                 |
|                                     |       | 百達基金(盧森堡)—生物科技                      | 百達基金(盧森堡)—精選品牌                            |
|                                     |       | 百達基金(盧森堡)—非專利醫藥                     | 亨德森遠見全球科技基金                               |

全球精選積極型投資帳戶、全球精選穩健型投資帳戶、全球精選保守型投資帳戶

|       |                           |                      |
|-------|---------------------------|----------------------|
|       | 亨德森遠見泛歐小型公司基金             | 亨德森遠見泛歐股票基金          |
|       | 貝萊德太平洋股票基金                | 貝萊德日本特別時機基金          |
|       | 貝萊德日本基金                   | 貝萊德日本價值型基金           |
|       | 貝萊德世界金融基金                 | 貝萊德世界能源基金            |
|       | 貝萊德世界健康科學基金               | 貝萊德世界黃金基金            |
|       | 貝萊德世界礦業基金                 | 貝萊德拉丁美洲基金            |
|       | 貝萊德新興市場基金                 | 貝萊德新興歐洲基金            |
|       | 貝萊德歐元市場基金                 | 貝萊德歐洲特別時機基金          |
|       | 貝萊德歐洲基金                   | 貝萊德環球特別時機基金          |
|       | 保德信中型成長基金                 | 施羅德環球基金系列—日本小型公司     |
|       | 施羅德環球基金系列—日本股票            | 施羅德環球基金系列—金磚四國       |
|       | 施羅德環球基金系列—美國小型公司          | 施羅德環球基金系列—新興亞洲       |
|       | 施羅德環球基金系列—歐元動力增長          | 施羅德環球基金系列—歐元增值       |
|       | 施羅德環球基金系列—歐洲小型公司          | 美盛價值基金               |
|       | 富通全球能源股票基金                | 富通美國智取基金             |
|       | 富達日本潛力優勢基金                | 富達基金—全球聚焦基金          |
|       | 富達基金—太平洋基金                | 富達基金—日本基金            |
|       | 富達基金—世界基金                 | 富達基金—全球金融服務基金        |
|       | 富達基金—星馬泰基金                | 富達基金—美國基金            |
|       | 富達基金—國際基金                 | 富達基金—歐洲小型企業基金        |
|       | 富達基金—歐洲基金                 | 富達基金—歐洲進取基金          |
|       | 富蘭克林坦伯頓世界基金               | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—大中華基金  |
|       | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—互利歐洲基金      | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—全球基金   |
|       | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—拉丁美洲基金      | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—金磚四國基金 |
|       | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列美國機會基金美元     | 富蘭克林坦伯頓成長基金          |
|       | 景順能源基金                    | 瑞銀(盧森堡)中歐股票基金        |
|       | 瑞銀(盧森堡)生化股票基金             | 瑞銀(盧森堡)保健股票基金        |
|       | 瑞銀(盧森堡)美國小型股票基金           | 瑞銀(盧森堡)美國價值投資股票基金    |
|       | 瑞銀(盧森堡)美國增長股票基金           | 瑞銀(盧森堡)策略基金—股票型      |
|       | 瑞銀(盧森堡)策略基金—增長型           | 瑞銀(盧森堡)歐洲中型股票基金      |
|       | 德盛日本基金                    | 德盛金磚四國基金             |
|       | 德盛德利全球生物科技基金              | 德盛德利全球資源產業基金         |
|       | 摩根士丹利日本價值股票基金             | 摩根士丹利拉丁美洲股票基金        |
|       | 摩根士丹利歐洲、中東及非洲新興股票基金       | 摩根士丹利環球房地產基金         |
|       | 摩根富林明基金—摩根富林明 JF 大中華基金    | 摩根富林明歐元股票基金—JF 歐元區   |
|       | 摩根富林明歐洲策略價值基金—摩根富林明歐洲策略價值 | 摩根富林明環球天然資源基金        |
|       | 鋒裕基金—新興歐洲及地中海股票           | 聯博—全球成長趨勢基金          |
|       | 聯博—全球價值型基金                | 聯博—全球複合型股票基金         |
|       | 聯博美國成長基金                  | 聯博—國際醫療基金            |
|       | 聯博—新興市場成長基金               | 聯博—歐洲價值型基金           |
|       | 駿利資產管理基金—駿利美國 20 基金       | 駿利資產管理基金—駿利美國各型股增長基金 |
|       | 駿利資產管理基金—駿利環球生命科技基金       | 駿利資產管理基金—駿利環球房地產基金   |
|       | 駿利資產管理基金—駿利環球科技基金         | 霸菱全球新興市場基金           |
|       | 霸菱全球資源基金                  | 霸菱拉丁美洲基金             |
|       | 霸菱東歐基金                    | 霸菱歐寶基金               |
| 海外債券型 | MFS 全盛美國政府債券基金            | MFS 全盛通脹調整債券基金       |
|       | MFS 全盛歐洲債券基金              | MFS 新興市場債券基金         |
|       | PIMCO 全球投資級別債券基金          | PIMCO 全球高收益債券基金      |
|       | PIMCO 新興市場債券基金            | PIMCO 總回報債券基金        |
|       | 百利達日圓債券基金                 | 百利達亞洲可換股債券基金         |
|       | 百利達美元債券基金                 | 百利達歐元債券基金            |
|       | 保德信新興市場固定收益基金             | 施羅德環球基金系列—亞洲債券       |

全球精選積極型投資帳戶、全球精選穩健型投資帳戶、全球精選保守型投資帳戶

|   |  |  |
|---|--|--|
|   | 施羅德環球基金系列－新興市場債券   | 施羅德環球基金系列－歐元債券   |
|   | 紐約銀行邁倫全球債券基金   | 富達基金－美元高收益基金   |
|   | 富達基金－歐洲高收益基金   | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－公司債基金  |
|   | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－全球債券基金   | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－亞洲債券基金   |
|   | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－美國政府基金   | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－新興國家固定收益基金   |
|   | 景順債券基金   | 瑞銀(盧森堡)美元債券基金  |
|   | 瑞銀(盧森堡)策略基金－固定收益型  | 瑞銀(盧森堡)新興市場債券基金  |
|   | 德盛德利國際債券基金   | 德盛德利歐洲債券基金   |
|   | 歐義銳榮日本債券基金   | 聯博－全球高收益債券基金   |
|   | 聯博－全球債券基金  | 聯博－歐洲收益基金  |
|   | 駿利資產管理基金－駿利美國高收益基金   | 霸菱高收益債券基金－美元季配   |
|   | 霸菱國際債券基金   |  |
| 海外<br>平衡<br>型   | MFS 全盛全球資產配置基金   | 貝萊德策略配置基金  |
|   | 貝萊德環球資產配置基金  | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－全球平衡基金   |
|   | 瑞銀(盧森堡)全球戰略配置精選基金  | 瑞銀(盧森堡)策略基金－平衡型  |
|   | 瑞銀(盧森堡)策略基金－收益型  | 德盛東方入息基金   |
|   | 聯博－全球平衡型基金   | 聯博－全球保守型基金   |
| 海外<br>貨幣<br>型   | JF 貨幣基金－港元   | 百利達短期英鎊基金  |
|   | 富達基金－美元現金基金  | 瑞銀(盧森堡)美元基金  |
|   | 瑞銀(盧森堡)澳幣基金  | 摩根富林明美元貨幣基金  |
|   | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列美元短期票券基金  | 西方資產美國貨幣市場基金   |
|   | 天達理財貨幣基金   | 天達美元貨幣基金   |
|   | 百利達短期美元基金  | 富達基金－歐元現金基金  |
|   | 瑞銀(盧森堡)歐元基金  | 景順美元儲備基金   |
|   | 德盛美元基金   | MFS 全盛美元貨幣市場基金   |
|   | 施羅德環球基金系列－美元流動   | 法興美元貨幣市場基金   |
| 基金<br>連結<br>標的  | 道瓊美國房地產指數基金<br>(iShares Dow Jones U.S. Real Estate Index Fund) | 羅素 2000 指數基金<br>(ISHARES RUSSEL 2000 INDEX FUND)                   |
|   | Vanguard Consumer Staples ETF                                  | 泛太平洋(不包含日本)指數基金<br>(iShares MSCI Pacific ex-Japan Index Fund)      |
|   | 道瓊歐盟 50 指數基金<br>(iShares DJ EURO Stoxx 50 (DE))                | 標準普爾 500 指數基金<br>(iShares S & P 500 Index Fund)                    |
|   | 標準普爾歐洲 350 指數基金<br>(iShares S&P Europe 350 Index Fund)         | 那斯達克 100 指數基金<br>(PowerShares QQQ Nasdaq 100)                      |
|   | 標準普爾拉丁美洲 40 指數基金<br>(ISHARES S&P LATIN AMERICA 40)             | 先鋒房地產信託指數基金<br>(Vanguard REIT ETF)                                 |
|   | Financial Select Sector SPDR ETF                               | MSCI 新興市場指數基金<br>(iShares MSCI Emerging Markets Index Fund)        |
|   | 標準普爾小型 600 指數基金<br>(ISHARES S&P SMALL CAP 600 INDEX FUND)      | MSCI 日本指數基金<br>(iShares MSCI Japan Index Fund)                     |
|   | 道瓊工業指數基金<br>(DIAMONDS Trust Series I)                          | 德國 DAX 指數基金<br>(iShares DAX (DE))                                  |
|   | 標準普爾全球 100 指數基金<br>(iShares S&P Global 100 Index Fund)         | 富時新華中國 25 指數基金<br>(iShares FTSE/Xinhua China 25 Index Fund)        |
|   | MSCI 金磚四國指數基金<br>(iShares MSCI BRIC Index Fund)                | 標準普爾亞洲 50 指數基金<br>(iShares S&P Asia 50 Index Fund)                 |
|   | iShares MSCI ACWI Index Fund                                   | ishares S&P Global Materials Sector Index Fund                     |
|   | iShares S&P Global Energy Sector Index Fund                    | 標準普爾中國指數基金<br>(SPDR S&P China ETF)                                 |
|   | EasyETF FTSE ET50 Environment                                  |  |
|   | 債券<br>型  | 美國 1-3 年政府票券指數基金<br>(iShares Barclays 1-3 Year Treasury Bond Fund) |
| 美國高收益公司債指數基金<br>(iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond Fund) |  | 泛歐 3-5 年公債指數基金<br>(Lyxor ETF EuroMTS 3-5Y)                         |

| 全球精選積極型投資帳戶、全球精選穩健型投資帳戶、全球精選保守型投資帳戶                                      |  |
|--|--|
| 泛歐 7-10 年公債指數基金<br>(Lyxor ETF EuroMTS 7-10Y)                             | iShares Barclays MBS Fixed-Rate Bond Fund                          |
| 美國投資級公司債券指數基金<br>(iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond Fund) | 美國 3-7 年政府票券指數基金<br>(iShares Barclays 3-7 Year Treasury Bond Fund) |
| 泛歐 5-7 年公債指數基金<br>(Lyxor ETF EuroMTS 5-7Y)                               | 泛歐 1-3 年公債指數基金<br>(Lyxor ETF EuroMTS 1-3Y)                         |
| SPDR Barclays International Treasury Bond ETF                            |  |

## 二、「投資標的帳戶價值」之計算：

### (一) 有單位價值之「投資標的」：

「投資標的帳戶價值」，係依該「投資標的」之單位價值，乘以本契約所有該「投資標的」之單位數而得。

「投資標的」之單位價值，係指以該「投資標的」於「評價日」之淨資產價值，除以已發行在外的「投資標的」單位總數後所得之值。

淨資產價值，等於該「投資標的」之總資產價值扣除總負債，再扣除該「投資標的」之經理費用及保管費用後之淨價值。

總資產價值，係以「評價日」「投資標的」報價市場或證券交易所當日之收盤價格為計價基礎。

總負債，包含應付取得或處分該「投資標的」資產之直接成本及必要費用、稅捐或其他法定費用。

### (二) 無單位價值之「投資標的」：

1. 「投資標的」為結構型債券者，其「投資標的帳戶價值」為「結構型債券淨投資金額」乘以「結構型債券市價相對價格比率」後，再扣除當日減少之金額（部分提領、轉換、解約之申請金額及「每月保單費用扣除額」）而得。

2. 「投資標的」為貨幣帳戶者，其「投資標的帳戶價值」為下列二者之累積淨額加總後，並按每日該二者之累積淨額以該「投資標的」每月宣告利率按單利方式逐日計算之本利和。

(1) 該「投資標的」之投入金額；

(2) 該「投資標的」之減少金額（部分提領、轉換、解約之申請金額及「每月保單費用扣除額」）。

## 三、「投資標的」轉換、部分提領或解約：

### (一) 要保人進行「投資標的」轉換或「保單帳戶價值」的部分提領時，應依下列規定處理：

#### 1. 「投資標的」轉換：

要保人應於申請書上載明轉出之「投資標的」或「結構型債券暫存帳戶」及各「投資標的」或「結構型債券暫存帳戶」之申請轉出金額，並載明欲轉入之「投資標的」及其分配比例。

要保人於同一保單年度內申請之「投資標的」轉換，若轉出之「投資標的」在四次（含）以內者，本公司不收取轉換費用，自第五次起每次申請轉換時，本公司每次將自轉出之金額中扣除轉換費用（每次不得高於新台幣壹仟元）。

自「結構型債券暫存帳戶」轉出之金額，其欲投入非結構型債券之「投資標的」者，每次皆須扣除「結構型債券暫存帳戶」轉出費用，該費用每次以不超過轉出金額之 3% 為限，詳如附件二。

欲轉入結構型債券者，須先將申請轉出金額扣除結構型債券申購手續費後，投入與原轉出之「投資標的」相同幣別之「結構型債券暫存帳戶」，並於該「結構型債券發行日」當日，將前一日該「結構型債券暫存帳戶價值」依第三條約定轉換為與該結構型債券計價幣別相同之金額後，投入該結

構型債券。前述結構型債券申購手續費以不超過轉出金額之 5% 為限，詳如附件二。

2. 「保單帳戶價值」的部分提領：

要保人應於申請書上載明部分提領之「投資標的」或「結構型債券暫存帳戶」及各「投資標的」或「結構型債券暫存帳戶」之申請部分提領金額。

要保人於同一保單年度內申請之「投資標的」部分提領，若「投資標的」之部分提領在四次（含）以內者，本公司不收取部分提領費用，自第五次起每次申請部分提領時，本公司每次將自部分提領之金額中扣除部分提領費用（每次不得高於新台幣壹仟元）。

(二) 計價日：

| 投資標的分類      | 轉出/部分提領/解約計價日 | 轉入計價日 |
|-------------|---------------|-------|
| 共同基金        | T+1           | T+1   |
| 基金連結標的      | T+1           | T+1   |
| 全球精選投資帳戶    | T+1           | T+1   |
| 貨幣帳戶        | T             | T+1   |
| 結構型債券       | T+1           | 不適用   |
| 「結構型債券暫存帳戶」 | T             | T+1   |

註：T表本公司收到申請文件齊全之日。

(三) 部分提領或轉換時的計價方式，應依下列規定處理：

1. 有單位價值之「投資標的」：可提領或轉出之金額為申請金額。

計價日當日個別「投資標的」應減少之單位數，為依申請金額除以當日個別「投資標的」單位價值所得之值。

2. 無單位價值之「投資標的」：

(1) 貨幣帳戶：可提領或轉出之金額為申請金額。

(2) 結構型債券：可提領或轉出之金額為申請金額。

計價日當日個別「投資標的帳戶價值」應減少之金額為申請金額。

3. 「結構型債券暫存帳戶」：可提領之金額為申請金額。

計價日當日「結構型債券暫存帳戶價值」應減少之金額為申請金額。

上述每次申請部分提領及轉換時之最低金額，依當時公司之規定。

## 【附件四】結構型債券說明

一、「結構型債券發行或保證機構」的說明 ---- 本契約提供之結構型債券(Structured Notes)，其發行或保證機構為下列之一：

- (一) 法國巴黎銀行 (BNP Paribas Bank)
  1. 國內分支機構：法商法國巴黎銀行台北分行
  2. 地址：台北市民生東路4段52號2-6樓
  3. 電話：02-2716-1167
- (二) 花旗銀行 (Citibank N.A.)
  1. 國內分支機構：美商花旗銀行台北分行
  2. 地址：台北市民生東路3段115號2樓之1,115號2樓之2,117-1號,117號2樓
  3. 電話：02-2715-5931
- (三) 荷蘭荷興銀行 (ING Bank NV)
  1. 國內分支機構：荷商安銀銀行台北分行
  2. 地址：台北市復興南路1段2號6樓
  3. 電話：02-2734-7600
- (四) 法國興業銀行 (Societe Generale)
  1. 國內分支機構：法國興業銀行台北分行
  2. 地址：台北市民生東路3段109號7樓
  3. 電話：02-2715-5050
- (五) 摩根大通銀行 (JP Morgan Chase Bank N.A.)
  1. 國內分支機構：美商摩根大通銀行台北分行
  2. 地址：台北市信義路5段108號8樓
  3. 電話：02-2725-9800
- (六) 摩根史丹利公司 (Morgan Stanley Dean Witter & Co.)
  1. 國內分支機構：英商摩根士丹利添惠證券有限公司台北分公司
  2. 地址：台北市敦化南路2段207號22樓
  3. 電話：02-2730-2888
- (七) 荷商荷蘭銀行 (ABN AMRO Bank)
  1. 國內分支機構：荷商荷蘭銀行台北分行
  2. 地址：台北市松仁路7號12, 16-18樓 (企業金融) 及89號一樓 (消費金融)
  3. 電話：02-8722-5000
- (八) 美林證券公司 (Merrill Lynch & Co., Inc.)
  1. 國內分支機構：美商美林證券股份有限公司台灣分公司
  2. 地址：台北市敦化南路2段207號18樓
  3. 電話：02-2376-3666
- (九) 德意志銀行 (Deutsche Bank)
  1. 國內分支機構：德商德意志銀行台北分行
  2. 地址：台北市仁愛路4段296號6,10,12,13樓
  3. 電話：02-2192-4666
- (十) 法國東方匯理銀行 (CALYON)
  1. 國內分支機構：法國東方匯理銀行台北分行
  2. 地址：台北市敦化北路167號16樓
  3. 電話：02-2717-5252
- (十一) 瑞士銀行 (UBS AG)
  1. 國內分支機構：瑞士商瑞士銀行台北分行
  2. 地址：台北市松仁路7號5,13,22,23樓
  3. 電話：02-8722-7888
- (十二) 匯豐銀行 (HSBC)
  1. 國內分支機構：香港上海匯豐銀行台北分行
  2. 地址：台北市基隆路1段333號13,14樓。
  3. 電話：02-8722-6999
- (十三) 瑞士信貸國際 (Credit Suisse International)

1. 國內分支機構：瑞士商瑞士信貸證券股份有限公司台北分公司
  2. 地址：台北市民生東路3段109號5樓
  3. 電話：02-2715-6388
- (十四) 澳洲紐西蘭銀行 (Australia and New Zealand Banking Group Limited)
1. 國內分支機構：澳商澳洲紐西蘭銀行台北分行
  2. 地址：台北市基隆路1段333號12樓1208室
  3. 電話：02-2757-7299
- (十五) 比利時聯合銀行 (KBC Bank N.V.)
1. 國內分支機構：比利時商比利時聯合銀行台北分行
  2. 地址：台北市復興北路99號15樓
  3. 電話：02-2712-9133
- (十六) 比利時商富通銀行 (Fortis Bank; Fortis Banque SA)
1. 國內分支機構：比利時商富通銀行台北分行
  2. 地址：台北市民生東路3段131號5樓
  3. 電話：02-2719-6331
- (十七) 德利銀行 (Dresdner Bank)
1. 國內分支機構：德商德利銀行台北代表人辦事處
  2. 地址：台北市民生東路3段138號6樓
  3. 電話：02-2719-0022
- (十八) 巴克萊銀行 (Barclays Bank PLC)
1. 國內分支機構：英商巴克萊銀行台北分行
  2. 地址：台北市信義路5段108號5樓
  3. 電話：02-8722-1809

二、連結標的之介紹--本契約提供之結構型債券，可連結之標的說明如下，本公司將於銷售時始決定，詳細內容以當時之說明書為準：

I、可連結之指數標的如下：

- (一) S&P 500 Index (標準普爾 500 指數)
  1. 由各產業具有代表性的 500 支股票，經由市值加權平均編製而成。
  2. 依 1941~1943 年之股價為基期 (基期為 10)。
- (二) DJ Eurostoxx 50 Index (道瓊歐盟 50 指數)
  1. 由歐洲 50 大藍籌股組成的市值加權平均指數。
  2. 該指數以 1991 年 12 月 31 日為基期 (基期為 1000)。
- (三) Nikkei 225 Index (日經 225 指數)
  1. 由東京股票交易所中特選 225 支股票按價格加權平均編製而成。
  2. 依 1949 年 5 月 16 日之股價為基期。
- (四) KOSPI (韓國 KOSPI 指數)
  1. 由所有在韓國股票交易所掛牌之普通股按市值加權平均編制而成。
  2. 依 1980 年 1 月 4 日之股價為基期 (基期為 100)。
- (五) KOSPI 200 Index (韓國 KOSPI200 指數)
  1. 由韓國證券交易所中精選 200 支股票按市值加權平均編製而成。
  2. 依 1990 年 1 月 3 日之股價為基期 (基期為 100)。
- (六) Nasdaq 100 Index (那斯達克 100 指數)
  1. 由在美國 NASDAQ 掛牌之大型非金融類股按市值加權平均編製而成。
  2. 以 1985 年 2 月 1 日之股價為基期。(基期為 125)
- (七) Dow Jones Industrial Average (道瓊工業指數)

由 30 家大型藍籌股按價格加權平均編製而成。
- (八) Nasdaq Composite Index (那斯達克綜合指數)
  1. 由在美國 Nasdaq 掛牌之股票按市價加權編製而成。
  2. 以 1971 年 2 月 5 日之指數為基期。(基期為 100)
- (九) Hang Seng Index (恆生指數)
  1. 在香港證券交易所上市的主要大型公司按市值加權平均編製而成。
  2. 以 1964 年 7 月 31 日為基期。(基期為 100)
- (十) CAC-40 Index (巴黎證商公會 40 指數)
  1. 由 40 家在法國 Paris Bourse 上市的公司按市值加權平均編製而成。
  2. 以 1987 年 12 月 31 日為基期。(基期為 1,000)
- (十一) FTSE 100 Index (英國金融時報 100 指數)

- 1.由倫敦證券交易所資本額前 100 大之上市公司按市值加權平均編製而成。
  - 2.以 1984 年 1 月 3 日為基期。(基期為 1,000)
- (十二) Topix Index (日本東證一部指數)
- 1.由東京證券交易所 First Section 掛牌之所有公司按市價加權平均編製而成。
  - 2.以 1968 年 1 月 4 日為基期。(基期為 100)
- (十三) Philadelphia Semiconductor Index (費城半導體指數)
- 1.由從事設計、運送、製造和銷售半導體的公司，依價格加權所組成。
  - 2.以 1993 年 12 月 1 日為基期(基期為 100)。
- (十四) NASDAQ Biotech Index (那斯達克生技指數)
- 1.那斯達克生技指數由所有在那斯達克掛牌的生技產業公司，依市值加權方式編製而成。
  - 2.以 1993 年 11 月 1 日為基期(基期為 200)。
- (十五) DJ Global Titan Index (道瓊全球泰坦指數)
- 由全球市值前 50 大股票所組成。
- (十六) Straits Times Index (海峽時報指數)
- 海峽時報指數為市值加權平均指數，主要涵蓋在新加坡證交所掛牌的最主要及最活躍的個股。
- (十七) S&P/ASX 200 Index (標準普爾 ASX200 指數)
- 標準普爾 ASX200 指數是由 200 家於澳大利亞股票交易所掛牌的企業依市值加權法所組成。
- (十八) Thailand Set 50 Index (泰國曼谷 SET50 指數)
- 1.曼谷 SET50 指數為依據指數內市值及流通性最高之前 50 檔股票之市值加權平均編制而成。
  - 2.依 1995 年 8 月 16 日之股價為基期 (基期為 100)。
- (十九) London Inter-Bank Offering Rate (LIBOR 倫敦同業拆款利率)
- 1.以倫敦時間早上 11:00 報價之利率為基準。
  - 2.此利率係由一群銀行對各參考期間之利率報價平均而得，此群銀行之決定是由英國銀行家協會 (British Bankers Association) 所指定的銀行中，剔除報價最高之前 25%及報價最低之前 25%後之剩餘銀行。
  - 3.此利率可於彭博 (Bloomberg)、美聯社 (Telerate) 等資訊系統公司查詢。
- (二十) CBOE 黃金指數 (CBOE Gold Index)
- 1.由多家以黃金探勘及生產為主要業務之公司股票按等比例加權平均編製而成。
  - 2.以 1994/12/16 為基期 (基期為 100)。
- (二十一) S&P 500 不動產指數 (S&P 500 Real Estate Index)
- 由多家美國不動產公司之股票按市值加權平均編製而成。
- (二十二) 北海布倫特原油指數 (Brent Crude Index)
- 為一衡量原油價格之指數。
- (二十三) 高盛美國商品指數 (Goldman Sachs US Commodity Index)
- 由流動性佳之多種大宗商品 (含能源產品、金屬產品、農產品)，按其權重加權平均編製而成。
- (二十四) 費城證交所黃金白銀指數 (Phila Gold & Silver Index)
- 由多家從事探勘及開採黃金白銀之大型領導公司之股票按市值加權平均編製而成。
- (二十五) 道瓊 AIG 商品指數 (DJ-AIG Commodity Index)
- 由流動性佳之多種大宗商品 (含能源產品、金屬產品、農產品) 之期貨合約價格，按其權重加權平均編製而成。
- (二十六) 道瓊美國不動產指數 (DJ US Real Estate Index)
- 由多檔於美國的證交所掛牌交易之不動產投資信託基金 (REIT) 按市值加權平均編製而成。
- (二十七) 倫敦黃金市場訂價公司下午盤定盤價 (London Gold Market Fixing Ltd PM Fix Price/USD)
- 由倫敦黃金市場訂價公司 (London Gold Market Fixing Ltd.) 所提供之黃金每盎司美元報價，定盤時間為每個倫敦營業日之下午 3 點。
- (二十八) 西德州中級原油最近月份期貨合約價格 (WTI Crude Oil nearest month future contract price)
- 由紐約商品交易所 (NYMEX/New York Merchantile Exchange) 公佈之西德州中級原油最近月份期貨合約之每日收盤價格。
- (二十九) 固定期限交換利率 (Constant Maturity Swap, 簡稱 CMS)
- 1.指某一固定年期之市場交換利率，該固定年期最短為 1 年，最長為 30 年；為市場廣泛使用之利率參考指標。
  - 2.可分為多種幣別之利率，最常見的為美元交換利率 (USD swap rate or USD CMS) 及歐元交換利率 (Euro swap rate or Euro CMS)，其資訊來源如下：
    - (1)美元交換利率 (USD swap rate or USD CMS)

由 British Banker Association (英國銀行家協會) 將所有投資銀行及商業銀行所報之美元交換利率中價 (mid swap market rates) 加以平均而得；每日收盤行情之認定為美國紐約時間上午 11:00。

(2) 歐元交換利率 (Euro swap rate or Euro CMS)

由 British Banker Association (英國銀行家協會) 挑選 7-8 家投資銀行及商業銀行所報之歐元交換利率中價 (mid swap market rates) 加以平均而得；每日收盤行情之認定為英國倫敦或德國法蘭克福時間上午 11:00 (視結構型債券之發行機構所在地而定)。

3. 此利率可於彭博 (Bloomberg)、美聯社 (Telerate) 等資訊系統公司查詢。

(三十) 東證 REIT 指數 (Tokyo Stock Exchange REIT Index, TSEREIT Index)

由掛牌於東京證交所之所有不動產投資信託 (REIT) 股票按市值加權平均編製而成。

(三十一) 富時歐洲不動產指數 (FTSE European Public Real Estate Index, EPRA Europe Index)

由歐洲地區成交量最活絡之不動產公司股票按市值加權平均編製而成。

(三十二) 德國股票指數 (DAX Index)

1. 由德國法蘭克福交易所中精選多支股票按市值加權平均編製而成。

2. 依 1987 年 12 月 31 日之股價為準 (基期為 1,000)。

(三十三) 阿姆斯特丹交易所指數 (Amsterdam Exchange Index)

1. 由荷蘭多檔藍籌股組成的市值加權平均指數。

2. 該指數於 1999 年 1 月 4 日歐元區正式成立時調整為 538.36 點。

(三十四) 西班牙 IBEX 指數 (IBEX 35 Index)

1. 由西班牙 35 支流動率最大之股票組成的市值加權平均指數。

2. 依 1989/12/29 之股價為準 (基期為 3,000)。

(三十五) 瑞士市場指數 (Swiss Market Index)

1. 由瑞士多檔藍籌股組成的市值加權平均指數。

2. 依 1988/6/30 之股價為準 (基期為 1,500)。

(三十六) 法蘭克福 TECDAX 指數 (TECDAX Performance Index)

1. 由德國股票交易所中選多支市值最大與流動率最高之高科技股票按市值加權平均編製而成。

2. 以 1997/12/30 為基期 (基期為 1,000)。

(三十七) MSCI 世界指數 (MSCI World Index)

1. MSCI World 指數是由全球多個國家之股票指數按市值加權平均編製而成。

2. MSCI World Index 包含多個已開發國家之指數：例如澳洲、奧地利、比利時、加拿大、丹麥、芬蘭、法國、德國、希臘、香港、愛爾蘭、義大利、日本、荷蘭、紐西蘭、挪威、葡萄牙、新加坡、西班牙、瑞典、瑞士、英國與美國。

(三十八) 羅素 2000 指數 (Russell 2000 Index)

1. 由 Russell 3000 指數中市值最小之 2000 家公司股票按市值加權平均編製而成。

2. 以 1986/12/31 之指數為基期 (基期為 135)。

(三十九) MSCI 新加坡指數 (MSCI Singapore Index)

由新加坡股票按市值加權平均編製而成。

(四十) 吉隆坡綜合股價指數 (KLCI Index)

1. 由吉隆坡證交所中選多支大型股按市值加權平均編製而成。

2. 以 1977 年 1 月 2 日之指數為基期 (基期為 100)。

(四十一) 標準普爾/NIFTY 指數 (India Nifty 50 Index)

1. 由掛牌於印度國家證交所之 50 家大型公司股票按市值加權平均編製而成。

2. 以 1995/11/3 為基期 (基期為 1,000)。

(四十二) 歐元兌美元即期匯價 (EUR/USD Spot)

1. 代表每一單位歐元可兌換之美元數目。

2. 全球主要外匯交易商之即期匯率，按等比例加權平均編製而成。

(四十三) 美元兌日圓即期匯價 (USD/JPY Spot)

1. 代表每一單位美元可兌換之日圓數目。

2. 全球主要外匯交易商之即期匯率，按等比例加權平均編製而成。

(四十四) 美元兌韓圓即期匯價 (USD/KRW Spot)

1. 代表每一單位美元可兌換之韓圓數目。

2. 全球主要外匯交易商之即期匯率，按等比例加權平均編製而成。

(四十五) 美元兌港幣即期匯價 (USD/HKD Spot)

1. 代表每一單位美元可兌換之港幣數目。

2. 全球主要外匯交易商之即期匯率，按等比例加權平均編製而成。

(四十六) 美元兌新加坡幣即期匯價 (USD/SGD Spot)

1. 代表每一單位美元可兌換之新加坡幣數目。

2. 全球主要外匯交易商之即期匯率，按等比例加權平均編製而成。

- (四十七) 加拿大幣兌美元即期匯價 (CAD/USD Spot)
- 1.代表每一單位加拿大幣可兌換之美元數目。
  - 2.全球主要外匯交易商之即期匯率，按等比例加權平均編製而成。
- (四十八) 澳幣兌美元即期匯價 (AUD/USD Spot)
- 1.代表每一單位澳幣可兌換之美元數目。
  - 2.全球主要外匯交易商之即期匯率，按等比例加權平均編製而成。
- (四十九) 紐幣兌美元即期匯價 (NZD/USD Spot)
- 1.代表每一單位紐幣可兌換之美元數目。
  - 2.全球主要外匯交易商之即期匯率，按等比例加權平均編製而成。
- (五十) 英鎊兌美元即期匯價 (GBP/USD Spot)
- 1.代表每一單位英鎊可兌換之美元數目。
  - 2.全球主要外匯交易商之即期匯率，按等比例加權平均編製而成。
- (五十一) 瑞士法郎兌美元即期匯價 (CHF/USD Spot)
- 1.代表每一單位瑞士法郎可兌換之美元數目。
  - 2.全球主要外匯交易商之即期匯率，按等比例加權平均編製而成。
- (五十二) 歐元兌日圓即期匯價 (EUR/JPY Spot)
- 1.代表每一單位歐元可兌換之日圓數目。
  - 2.全球主要外匯交易商之即期匯率，按等比例加權平均編製而成。
- (五十三) 富時全球景氣循環類股指數 (FTSE Global Cyclical Index)
- 由多支住宅用品、紡織、一般零售類、休閒、旅館類、服務業類、運輸類公司股票組合而成可供交易的指數。
- (五十四) 富時全球能源類股指數 (FTSE Global Energy Index)
- 由多支石油與天然氣類公司股票組合而成可供交易的指數。
- (五十五) 富時全球公共事業類股指數 (FTSE Global Utilities Index)
- 由多支電力及公共事業類公司股票組合而成可供交易的指數。
- (五十六) 印度孟買 SENSEX 30 指數 (BSE Sensex 30 Index)
- 1.為一市值加權平均指數，成份股入選標準包含流動性交易狀態流通股票調整狀態以及產業代表性。
  - 2.以 1978-1979 年為基期 (基期為 100)。
- (五十七) 巴西聖保羅證交所指數 (Brazil Bovespa Stock Index)
- 以聖保羅證交所流通性高的股票所編製的指數。
- (五十八) 俄羅斯 RTS 美元指數 (Russian RTS Index \$)
- 1.俄羅斯 RTS 美元指數為依據美元計值的市值加權平均指數且涵蓋在俄羅斯交易系統裡 (Russian Trading System) 的交易股票。
  - 2.以 1995 年 9 月 1 日為基期 (基期為 100)。
- (五十九) 標準普爾高盛商品指數 (S&P GSCI Index)
- 由高盛證券與標準普爾共同編纂的商品指數，成份包含能源、農產品、工業用金屬、畜牧產品、貴重金屬。
- (六十) 標準普爾高盛商品超額報酬指數 (S&P GSCI Excess Return Index)
- 由高盛證券與標準普爾共同編纂的商品指數，成份包含能源、農產品、工業用金屬、畜牧產品、貴重金屬。
- (六十一) 標準普爾高盛能源超額報酬指數 (S&P GSCI Energy Excess Return Index)
- 為標準普爾高盛商品指數 (S&P GSCI Index) 旗之下子指數。該指數包含原油，汽油，熱燃油，布蘭特原油，原料油及天然氣。
- (六十二) 標準普爾高盛貴金屬指數 (S&P GSCI Precious Metal Index)
- 為標準普爾高盛商品指數 (S&P GSCI Index) 旗之下子指數。該指數包含金，銀。
- (六十三) 標準普爾高盛農產品指數 (S&P GSCI Agriculture Index)
- 為標準普爾高盛商品指數 (S&P GSCI Index) 旗之下子指數。該指數包含小麥，玉米，黃豆，棉花，糖，咖啡及可可。
- (六十四) Wilderhill 新能源環球指數 (WilderHill New Energy Global Innovation Index)
- 1.由 WilderHill New Energy Finance, LLC 依市值法調整權重之新能源指數，成分為多檔公開發行之替代能源相關類股。
  - 2.以 2002 年 12 月 30 日為基期 (基期為 100)。
- (六十五) MSCI 新興市場指數 (MSCI Emerging Markets Index)
- 由 MSCI 編制，涵蓋了多個新興市場，並根據 GDP、市場流動性、政府與法規、投資風險、外國人投資比例、以及一般市場認知決定指數的成分。

- (六十六) MSCI 新加坡現金指數 (MSCI Singapore Cash Index)
- 1.由 MSCI 編制，以新加坡幣計價之指數。該指數之成分股為新加坡掛牌交易具代表性之股票。
  - 2.以 1988 年 1 月 1 日之指數為基期 (基期為 100)。
- (六十七) 標準普爾高盛農產品超額報酬指數 (S&P GSCI Agriculture Excess Return Index)
- 為標準普爾高盛商品超額報酬指數 (S&P GSCI Excess Return Index) 旗下之子指數。該指數包含小麥，玉米，黃豆，棉花，糖，咖啡及可可。
- (六十八) RICI 第二代商品價格指數 (RICI Enhanced Index ER)
- 1.由吉姆羅傑斯 (Jim Rogers) 與荷商荷蘭銀行共同編製的商品指數，每半年會重設權重分配。
  - 2.旗下分為能源商品、農業商品、金屬商品三大主要子指數，共連結多種商品期貨，包括原油、天然氣、鋁、銅、黃金、小麥、玉米、咖啡、棉花...等。
  - 3.1998/07/31 開始掛牌交易。
- (六十九) RICI 第二代商品完全收益指數 (RICI Enhanced Index)
- 1.由吉姆羅傑斯 (Jim Rogers) 與荷商荷蘭銀行共同編製的商品指數，每半年會重設權重分配。
  - 2.旗下分為能源商品、農業商品、金屬商品三大主要子指數，共連結多種商品期貨，包括原油、天然氣、鋁、銅、黃金、小麥、玉米、咖啡、棉花...等。
  3. 1998/07/31 開始掛牌交易。
- (七十) RICI 第二代金屬商品價格指數 (RICI Enhanced Metals Excess Return Index)
- 1.為 RICI 第二代商品價格指數 (RICI Enhanced Index ER) 旗下的子基金，連結商品期貨包括鋁、銅、鉛、鎳、錫、鋅、鈮、黃金、銀、白金。
  - 2.1998/07/31 開始掛牌交易。
- (七十一) RICI 第二代金屬商品完全收益指數 (RICI Enhanced Metals Index)
- 1.為 RICI 第二代商品完全收益指數 (RICI Enhanced Index) 旗下的子基金，連結商品期貨包括鋁、銅、鉛、鎳、錫、鋅、鈮、黃金、銀、白金。
  - 2.1998/07/31 開始掛牌交易。
- (七十二) RICI 第二代能源商品價格指數 (RICI Enhanced Energy Excess Return Index)
- 1.為 RICI 第二代商品價格指數 (RICI Enhanced Index ER) 旗下的子基金，連結商品期貨包括原油期貨、布蘭特原油 (Brent)、RBOB 汽油、天然氣、熱燃油 (heating oil)、製氣油 (gasoil)。
  - 2.1998/07/31 開始掛牌交易。
- (七十三) RICI 第二代能源商品完全收益指數 (RICI Enhanced Energy Index)
- 1.為 RICI 第二代商品完全收益指數 (RICI Enhanced Index) 旗下的子基金，連結商品期貨包括原油期貨、布蘭特原油 (Brent)、RBOB 汽油、天然氣、熱燃油 (heating oil)、製氣油 (gasoil)。
  - 2.1998/07/31 開始掛牌交易。
- (七十四) RICI 第二代農業商品價格指數 (RICI Enhanced Agriculture Excess Return Index)
- 1.為 RICI 第二代商品價格指數 (RICI Enhanced Index ER) 旗下的子基金，連結商品期貨包括小麥 (Wheat)、堪薩斯小麥 (Kansas City Wheat)、明尼亞波里斯小麥 (Minneapolis Wheat)、玉米、大豆、糖、咖啡、可可、黃豆油、羅布斯塔咖啡 (Coffee Robusta)、大豆粉 (Soymeal)、橙汁 (Orange Juice)、棉花、棕櫚油、米、燕麥、瘦肉條、活牛 (Live Cattle)、木材 (Lumber)、大麥 (Barley)、橡膠。
  - 2.1998/07/31 開始掛牌交易。
- (七十五) RICI 第二代農業商品完全收益指數 (RICI Enhanced Agriculture Index)
- 1.為 RICI 第二代商品價格指數 (RICI Enhanced Index) 旗下的子基金，連結商品期貨包括小麥 (Wheat)、堪薩斯小麥 (Kansas City Wheat)、明尼亞波里斯小麥 (Minneapolis Wheat)、玉米、大豆、糖、咖啡、可可、黃豆油、羅布斯塔咖啡 (Coffee Robusta)、大豆粉 (Soymeal)、橙汁 (Orange Juice)、棉花、棕櫚油、米、燕麥、瘦肉條、活牛 (Live Cattle)、木材 (Lumber)、大麥 (Barley)、橡膠。
  2. 1998/07/31 開始掛牌交易。
- (七十六) Hong Kong Interbank Offered Rate (HIBOR 香港同業拆款利率)
- 1.香港銀行同業拆息，又稱“HIBOR”，全名為“Hong Kong Interbank Offer Rate”，是銀行在同業市場拆借資金的息率。
  - 2.以香港早上 11:00 於 Telerate Page 9898 報價利率為基準。

II、可連結之基金標的如下：

| 項次 | 基金名稱                | 基金種類 | 投資區域 | 計價幣別 | 發行機構       |
|----|---------------------|------|------|------|------------|
| 1  | 德盛德利全球生物科技基金        | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 德利投資信託公司   |
| 2  | 德盛德利全球股票基金          | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 德利投資信託公司   |
| 3  | 德盛德利全球高科技基金         | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 德利投資信託公司   |
| 4  | 德盛德利全球資源產業基金        | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 德利投資信託公司   |
| 5  | 德盛德利國際債券基金          | 債券型  | 全球型  | 歐元   | 德利投資信託公司   |
| 6  | 德盛德利德國基金            | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 德利投資信託公司   |
| 7  | 德盛德利歐洲成長基金          | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 德利投資信託公司   |
| 8  | 德盛德利歐洲基金            | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 德利投資信託公司   |
| 9  | 德盛德利歐洲債券基金          | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 德利投資信託公司   |
| 10 | 德盛全球高成長科技基金         | 股票型  | 全球型  | 美元   | 德盛安聯資產管理公司 |
| 11 | 德盛東方入息基金-I類股份       | 平衡型  | 區域型  | 美元   | 德盛安聯資產管理公司 |
| 12 | 富達基金-全球工業基金         | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 13 | 富達基金-全球工業基金(B股)     | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 14 | 富達基金-太平洋基金          | 股票型  | 區域型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 15 | 富達基金-日本小型企業基金       | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 富達投資集團     |
| 16 | 富達基金-日本小型企業基金(B股)   | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富達投資集團     |
| 17 | 富達基金-日本基金           | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 富達投資集團     |
| 18 | 富達基金-日本基金(B股)       | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富達投資集團     |
| 19 | 富達基金-北歐基金           | 股票型  | 區域型  | 瑞典幣  | 富達投資集團     |
| 20 | 富達基金-世界基金           | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 21 | 富達基金-印尼基金           | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富達投資集團     |
| 22 | 富達基金-法國基金           | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 富達投資集團     |
| 23 | 富達基金-全球金融服務基金       | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 24 | 富達基金-南歐基金           | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 25 | 富達基金-星馬泰基金          | 股票型  | 區域型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 26 | 富達基金-全球科技基金         | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 27 | 富達基金-美元高收益基金        | 債券型  | 全球型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 28 | 富達基金-美元高收益基金(B股月配息) | 債券型  | 全球型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 29 | 富達基金-美元債券基金         | 債券型  | 全球型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 30 | 富達基金-美國多元基金         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富達投資集團     |
| 31 | 富達基金-美國成長基金         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富達投資集團     |
| 32 | 富達基金-美國基金           | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富達投資集團     |
| 33 | 富達基金-英國基金           | 股票型  | 單一國家 | 英鎊   | 富達投資集團     |
| 34 | 富達基金-英鎊債券基金         | 債券型  | 單一國家 | 英鎊   | 富達投資集團     |
| 35 | 富達基金-泰國基金           | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富達投資集團     |
| 36 | 富達基金-馬來西亞基金         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富達投資集團     |
| 37 | 富達基金-全球健康護理基金       | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 38 | 富達基金-全球健康護理基金(B股)   | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 39 | 富達基金-國際基金           | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 40 | 富達基金-國際債券基金         | 債券型  | 全球型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 41 | 富達基金-瑞士基金           | 股票型  | 單一國家 | 瑞士法郎 | 富達投資集團     |
| 42 | 富達基金-義大利基金          | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 富達投資集團     |
| 43 | 富達基金-全球電訊基金         | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 44 | 富達基金-全球電訊基金(B股)     | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 45 | 富達基金-德國基金           | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 富達投資集團     |
| 46 | 富達基金-歐元藍籌基金         | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 47 | 富達基金-歐元藍籌基金(B股)     | 股票型  | 區域型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 48 | 富達基金-歐洲小型企業基金       | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 49 | 富達基金-歐洲小型企業基金(B股)   | 股票型  | 區域型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 50 | 富達基金-歐洲平衡基金         | 平衡型  | 區域型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 51 | 富達基金-歐洲高收益基金        | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 52 | 富達基金-歐洲高收益基金(B股月配息) | 債券型  | 區域型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 53 | 富達基金-歐洲基金           | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 54 | 富達基金-歐洲基金(B股)       | 股票型  | 區域型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 55 | 富達基金-歐洲進取基金         | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 56 | 富達基金-歐盟 50TM 基金     | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 57 | 富達基金-歐盟 50TM 基金(B股) | 股票型  | 區域型  | 美元   | 富達投資集團     |
| 58 | 富達基金-澳洲基金           | 股票型  | 單一國家 | 澳幣   | 富達投資集團     |
| 59 | 富達基金-澳洲基金(B股)       | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富達投資集團     |
| 60 | 富達基金-韓國基金           | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富達投資集團     |
| 61 | 富達基金-日本潛力優勢基金       | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 富達投資集團     |
| 62 | 富達基金-印度聚焦基金         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富達投資集團     |
| 63 | 富達基金-歐洲大型企業基金       | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 富達投資集團     |
| 64 | ING(L)銀行及保險投資基金     | 股票型  | 全球型  | 美元   | ING 資產管理公司 |
| 65 | ING(L)生物科技投資基金      | 股票型  | 全球型  | 美元   | ING 資產管理公司 |

| 項次  | 基金名稱                                      | 基金種類 | 投資區域 | 計價幣別 | 發行機構                                    |
|-----|---|------|------|------|---|
| 66  | ING(L)歐洲新興市場投資基金                          | 股票型  | 區域型  | 歐元   | ING 資產管理公司                              |
| 67  | ING(L)歐元高股息投資基金                           | 股票型  | 區域型  | 歐元   | ING 資產管理公司                              |
| 68  | ING(L)新興市場投資基金                            | 股票型  | 區域型  | 美元   | ING 資產管理公司                              |
| 69  | ING(L)歐洲股票投資基金                            | 股票型  | 區域型  | 歐元   | ING 資產管理公司                              |
| 70  | ING(L)環球高股息投資基金                           | 股票型  | 全球型  | 美元   | ING 資產管理公司                              |
| 71  | ING(L)日本投資基金                              | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | ING 資產管理公司                              |
| 72  | ING(L)Renta 環球高收益基金                       | 債券型  | 全球型  | 歐元   | ING 資產管理公司                              |
| 73  | JF 東協基金                                   | 股票型  | 區域型  | 美元   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 74  | JF 澳洲基金                                   | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 75  | JF 日本店頭市場基金                               | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 76  | JF 日本小型企業(日圓)基金                           | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 77  | JF 日本(日圓)基金                               | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 78  | JF 日本科技基金                                 | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 79  | JF 南韓基金                                   | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 80  | JF 貨幣基金—港元                                | 貨幣型  | 單一國家 | 港幣   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 81  | JF 馬來西亞基金                                 | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 82  | JF 太平洋科技基金                                | 股票型  | 區域型  | 美元   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 83  | JF 菲律賓基金                                  | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 84  | JF 泰國基金                                   | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明基金(亞洲)有限公司                         |
| 85  | 摩根富林明拉丁美洲基金—JF 拉丁美洲(美元)—A 股(分派)           | 股票型  | 區域型  | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 86  | 摩根富林明東歐基金—JF 東歐(歐元)—A 股(分派)               | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 87  | 摩根富林明美洲基金—JF 美國增長(美元)—A 股(分派)             | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 88  | 摩根富林明美國微型企業基金—JF 美國微型企業(美元)—A 股(分派)       | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 89  | 摩根富林明美國價值基金—JF 美國價值(美元)—A 股(分派)           | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 90  | 摩根富林明基金 II—美元—JF 美元                       | 貨幣型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 91  | 摩根富林明基金 II—歐元—JF 歐元                       | 貨幣型  | 區域型  | 歐元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 92  | 摩根富林明歐元股票基金—JF 歐元區(美元)—A 股(分派)            | 股票型  | 區域型  | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 93  | 摩根富林明歐元區股票基金—摩根富林明歐元區股票(歐元)—A 股(分派)       | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 94  | 摩根富林明歐洲小型企業基金—JF 歐洲小型企業(歐元)—A 股(分派)       | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 95  | 摩根富林明歐洲科技基金—JF 歐洲科技(歐元)—A 股(分派)           | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 96  | 摩根富林明歐洲動力基金—JF 歐洲動力(歐元)—A 股(分派)           | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 97  | 摩根富林明歐洲基金—摩根富林明歐洲(歐元)—A 股(分派)             | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 98  | 摩根富林明歐洲基金—JF 歐洲(美元)—A 股(分派)               | 股票型  | 區域型  | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 99  | 摩根富林明環球股票基金—JF 環球(美元)—A 股(分派)             | 股票型  | 全球型  | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 100 | 摩根富林明新興中東基金—摩根富林明新興中東(美元)—A 股(分派)         | 股票型  | 區域型  | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 101 | 摩根富林明美國動力基金—摩根富林明美國動力(美元)—A 股(分派)         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 102 | 摩根富林明美國策略成長基金—摩根富林明美國策略成長(美元)—A 股(分派)     | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 103 | 摩根富林明美國複合收益基金—摩根富林明美國複合收益 A 股(入息)—美元      | 債券型  | 單一國家 | 美元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 104 | 摩根富林明歐洲動力巨型企業基金—摩根富林明歐洲動力巨型企業(歐元)—A 股(分派) | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 105 | 摩根富林明歐洲策略成長基金—摩根富林明歐洲策略成長(歐元)—A 股(分派)     | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 106 | 摩根富林明歐洲策略價值基金—摩根富林明歐洲策略價值(歐元)—A 股(分派)     | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 107 | 摩根富林明環球天然資源基金—摩根富林明環球天然資源(歐元)—A 股(分派)     | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 摩根富林明資產管理(歐洲)有限公司                       |
| 108 | 美盛日本股票基金                                  | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | LEGG MASON INVESTMENTS(LUXEMBOURG) S.A. |
| 109 | 美盛歐洲(除英國外)股票基金                            | 股票型  | 區域型  | 歐元   | LEGG MASON INVESTMENTS(LUXEMBOURG) S.A. |
| 110 | 美盛美元貨幣基金                                  | 貨幣型  | 單一國家 | 美元   | LEGG MASON INVESTMENTS(LUXEMBOURG) S.A. |
| 111 | 美盛歐元貨幣基金                                  | 貨幣型  | 區域型  | 歐元   | LEGG MASON INVESTMENTS(LUXEMBOURG) S.A. |
| 112 | 百達基金(盧森堡)—電訊(USD)                         | 股票型  | 全球型  | 美元   | 百達資產管理                                  |
| 113 | 百達基金(盧森堡)—水資源(EUR)                        | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 百達資產管理                                  |

| 項次  | 基金名稱                   | 基金種類 | 投資區域 | 計價幣別 | 發行機構   |
|-----|------------------------|------|------|------|--|
| 114 | 百達基金(盧森堡)-生物科技(USD)    | 股票型  | 全球型  | 美元   | 百達資產管理                                       |
| 115 | 百達基金(盧森堡)-非專利醫藥(USD)   | 股票型  | 全球型  | 美元   | 百達資產管理                                       |
| 116 | 百達基金(盧森堡)-精選品牌(EUR)    | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 百達資產管理                                       |
| 117 | 百達基金(盧森堡)-生物科技(EUR)    | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 百達資產管理                                       |
| 118 | 百達基金(盧森堡)-非專利醫藥(EUR)   | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 百達資產管理                                       |
| 119 | 百達基金(盧森堡)-水資源(USD)     | 股票型  | 全球型  | 美元   | 百達資產管理                                       |
| 120 | 鋒裕基金-美國鋒裕基金 A2         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 121 | 鋒裕基金-美國鋒裕基金 A2(歐元)     | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 122 | 鋒裕基金-美國研究 A2           | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 123 | 鋒裕基金-美國研究 A2(歐元)       | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 124 | 鋒裕基金-核心歐洲股票 A2         | 股票型  | 區域型  | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 125 | 鋒裕基金-核心歐洲股票 A2(歐元)     | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 126 | 鋒裕基金-新興歐洲及地中海股票 A2     | 股票型  | 區域型  | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 127 | 鋒裕基金-新興歐洲及地中海股票 A2(歐元) | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 128 | 鋒裕基金-歐陸股票 A2           | 股票型  | 區域型  | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 129 | 鋒裕基金-歐陸股票 A2(歐元)       | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 130 | 鋒裕基金-歐洲研究 A2           | 股票型  | 區域型  | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 131 | 鋒裕基金-歐洲研究 A2(歐元)       | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 132 | 鋒裕基金-歐洲小型企業 A2         | 股票型  | 區域型  | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 133 | 鋒裕基金-歐洲小型企業 A2(歐元)     | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 134 | 鋒裕基金-日本股票 A2           | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 135 | 鋒裕基金-日本股票 A2(歐元)       | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 136 | 鋒裕基金-策略收益 A2           | 債券型  | 全球型  | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 137 | 鋒裕基金-策略收益 A2(歐元)       | 債券型  | 全球型  | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 138 | 鋒裕基金-領先歐洲企業 A2         | 股票型  | 區域型  | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 139 | 鋒裕基金-領先歐洲企業 A2(歐元)     | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 140 | 鋒裕基金-領先環球企業 A2         | 股票型  | 全球型  | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 141 | 鋒裕基金-領先環球企業 A2(歐元)     | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 142 | 鋒裕基金-美國大型資本成長 A2       | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 143 | 鋒裕基金-美國大型資本成長 A2(歐元)   | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 144 | 鋒裕基金-美國中型資本價值 A2       | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 145 | 鋒裕基金-美國中型資本價值 A2(歐元)   | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 146 | 鋒裕基金-美國小型企業 A2         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 147 | 鋒裕基金-美國小型企業 A2(歐元)     | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 148 | 鋒裕基金-美國價值 A2           | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 149 | 鋒裕基金-美國價值 A2(歐元)       | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 150 | 鋒裕基金-美國高息公司債券 A2       | 債券型  | 單一國家 | 美元   | 鋒裕資產管理公司                                     |
| 151 | 安本環球-亞太股票基金            | 股票型  | 區域型  | 美元   | 安本資產管理公司                                     |
| 152 | 安本環球-日本股票基金(日幣)        | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 安本資產管理公司                                     |
| 153 | 天達美元貨幣基金 A 股           | 貨幣型  | 單一國家 | 美元   | 天達資產管理根西島有限公司                                |
| 154 | 天達美國股票基金 C 股           | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 天達資產管理根西島有限公司                                |
| 155 | 天達歐洲大陸股票基金 C 股         | 股票型  | 區域型  | 美元   | 天達資產管理根西島有限公司                                |
| 156 | 天達環球能源基金 C 股           | 股票型  | 全球型  | 美元   | 天達資產管理根西島有限公司                                |
| 157 | 天達投資評級公司債券基金 C 股       | 債券型  | 全球型  | 美元   | 天達資產管理根西島有限公司                                |
| 158 | 天達環球動力基金 C 股           | 股票型  | 全球型  | 美元   | 天達資產管理根西島有限公司                                |
| 159 | 天達環球策略股票基金 C 股         | 股票型  | 全球型  | 美元   | 天達資產管理根西島有限公司                                |
| 160 | 天達環球策略管理基金 C 股         | 平衡型  | 全球型  | 美元   | 天達資產管理根西島有限公司                                |
| 161 | 天達環球黃金基金 C 股           | 股票型  | 全球型  | 美元   | 天達資產管理根西島有限公司                                |
| 162 | 天達環球增長基金 C 股           | 股票型  | 全球型  | 美元   | 天達資產管理根西島有限公司                                |
| 163 | 先機日本股票基金 A             | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 先機基金管理(愛爾蘭)有限公司                              |
| 164 | 先機完全回報美元債券基金 A         | 債券型  | 單一國家 | 美元   | 先機基金管理(愛爾蘭)有限公司                              |
| 165 | 先機亞太股票基金 A 股           | 股票型  | 區域型  | 美元   | 先機基金管理(愛爾蘭)有限公司                              |
| 166 | 先機美國大型企業成長基金 A         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 先機基金管理(愛爾蘭)有限公司                              |
| 167 | 先機美國各型企業價值基金 A         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 先機基金管理(愛爾蘭)有限公司                              |
| 168 | 先機美國資本成長基金 A           | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 先機基金管理(愛爾蘭)有限公司                              |
| 169 | 先機美國價值基金 A             | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 先機基金管理(愛爾蘭)有限公司                              |
| 170 | 先機歐洲股票基金 A             | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 先機基金管理(愛爾蘭)有限公司                              |
| 171 | 先機環球股票基金 A             | 股票型  | 全球型  | 美元   | 先機基金管理(愛爾蘭)有限公司                              |
| 172 | 利安資金日本增長基金(新元)         | 股票型  | 單一國家 | 新加坡幣 | 利安資金管理有限公司<br>(LION CAPITAL MANAGEMENT LTD.) |
| 173 | 利安資金印度基金(美元)           | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 利安資金管理有限公司<br>(LION CAPITAL MANAGEMENT LTD.) |
| 174 | 利安資金印度基金(新元)           | 股票型  | 單一國家 | 新加坡幣 | 利安資金管理有限公司<br>(LION CAPITAL MANAGEMENT LTD.) |
| 175 | 利安資金馬來西亞基金(新元)         | 股票型  | 單一國家 | 新加坡幣 | 利安資金管理有限公司<br>(LION CAPITAL MANAGEMENT LTD.) |
| 176 | 利安資金新加坡均衡基金(美元)        | 平衡型  | 單一國家 | 美元   | 利安資金管理有限公司                                   |

| 項次  | 基金名稱                             | 基金種類 | 投資區域 | 計價幣別 | 發行機構   |
|-----|----------------------------------|------|------|------|--|
|     |                                  |      |      |      | (LION CAPITAL MANAGEMENT LTD.)               |
| 177 | 利安資金新加坡均衡基金(新元)                  | 平衡型  | 單一國家 | 新加坡幣 | 利安資金管理有限公司<br>(LION CAPITAL MANAGEMENT LTD.) |
| 178 | 利安資金新馬基金(新元)                     | 股票型  | 區域型  | 新加坡幣 | 利安資金管理有限公司<br>(LION CAPITAL MANAGEMENT LTD.) |
| 179 | 貝萊德太平洋股票基金 A2 美元                 | 股票型  | 區域型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 180 | 貝萊德日本特別時機基金 A2 日圓                | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 181 | 貝萊德日本特別時機基金 A2 美元                | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 182 | 貝萊德日本特別時機基金 A2 歐元                | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 183 | 貝萊德日本基金 A2 美元                    | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 184 | 貝萊德日本價值型基金 A2 日圓                 | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 185 | 貝萊德日本價值型基金 A2 美元                 | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 186 | 貝萊德日本價值型基金 A2 歐元                 | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 187 | 貝萊德日本價值型基金 C2 美元                 | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 188 | 貝萊德世界金融基金 A2 美元                  | 股票型  | 全球型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 189 | 貝萊德世界金融基金 A2 歐元                  | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 190 | 貝萊德世界能源基金 A2 美元                  | 股票型  | 全球型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 191 | 貝萊德世界能源基金 A2 歐元                  | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 192 | 貝萊德世界黃金基金 A2 美元                  | 股票型  | 全球型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 193 | 貝萊德世界黃金基金 A2 歐元                  | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 194 | 貝萊德世界礦業基金 A2 美元                  | 股票型  | 全球型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 195 | 貝萊德世界礦業基金 A2 歐元                  | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 196 | 貝萊德印度基金 A2 美元                    | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 197 | 貝萊德印度基金 A2 歐元                    | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 198 | 貝萊德拉丁美洲基金 A2 美元                  | 股票型  | 區域型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 199 | 貝萊德拉丁美洲基金 A2 歐元                  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 200 | 貝萊德美國小型企業價值型基金 A2 美元             | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 201 | 貝萊德美國特別時機基金 A2 美元                | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 202 | 貝萊德美國精選價值型基金 A2 美元               | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 203 | 貝萊德美國精選價值型基金 A2 歐元               | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 204 | 貝萊德美國價值型基金 A2 美元                 | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 205 | 貝萊德美國價值型基金 A2 歐元                 | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 206 | 貝萊德美國靈活股票基金 A2 美元                | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 207 | 貝萊德美國靈活股票基金 A2 歐元                | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 208 | 貝萊德英國基金 A2 英鎊                    | 股票型  | 單一國家 | 英鎊   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 209 | 貝萊德美元儲備基金 A2 美元                  | 貨幣型  | 全球型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 210 | 貝萊德貨幣基金 Hedged A2 歐元             | 貨幣型  | 全球型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 211 | 貝萊德新能源基金 A2 美元                   | 股票型  | 全球型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 212 | 貝萊德新能源基金 A2 歐元                   | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 213 | 貝萊德新興市場基金 A2 美元                  | 股票型  | 區域型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 214 | 貝萊德新興歐洲基金 A2 美元                  | 股票型  | 區域型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 215 | 貝萊德新興歐洲基金 A2 歐元                  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 216 | 貝萊德歐元市場基金 A2 歐元                  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 217 | 貝萊德歐洲特別時機基金 A2 美元                | 股票型  | 區域型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 218 | 貝萊德歐洲特別時機基金 A2 歐元                | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 219 | 貝萊德歐洲基金 A2 美元                    | 股票型  | 區域型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 220 | 貝萊德歐洲基金 A2 歐元                    | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 221 | 貝萊德歐元優質債券基金 A2 歐元                | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 222 | 貝萊德歐洲價值型基金 A2 歐元                 | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 223 | 貝萊德歐洲增長型基金 A2 歐元                 | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 224 | 貝萊德歐洲靈活股票基金 A2 歐元                | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 225 | 貝萊德環球小型企業基金 A2 美元                | 股票型  | 全球型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 226 | 貝萊德環球股票基金 A2 美元                  | 股票型  | 全球型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 227 | 貝萊德環球股票基金 A2 歐元                  | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 228 | 貝萊德環球特別時機基金 A2 美元                | 股票型  | 全球型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 229 | 貝萊德環球基本價值型基金 A2 美元               | 股票型  | 全球型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 230 | 貝萊德環球資產配置基金 A2 美元                | 平衡型  | 全球型  | 美元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 231 | 貝萊德環球資產配置基金 A2 歐元                | 平衡型  | 全球型  | 歐元   | 貝萊德(盧森堡)公司                                   |
| 232 | 富蘭克林坦伯頓成長基金 A 股                  | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團                                  |
| 233 | 富蘭克林坦伯頓世界基金 A 股                  | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團                                  |
| 234 | 富蘭克林坦伯頓外國基金 A 股                  | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團                                  |
| 235 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列一成長(歐元)基金歐元 A(acc)股 | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團                                  |
| 236 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列一全球基金美元 A(Ydis)股    | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團                                  |
| 237 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列一全球基金美元 B(acc)股     | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團                                  |
| 238 | 富蘭克林坦伯頓中小型公司成長基金 A 股             | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團                                  |

| 項次  | 基金名稱                            | 基金種類 | 投資區域 | 計價幣別 | 發行機構          |
|-----|---------------------------------|------|------|------|---------------|
| 239 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－拉丁美洲基金美元 A(Ydis)股 | 股票型  | 區域型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團   |
| 240 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－韓國基金美元 A(acc)股    | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團   |
| 241 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－泰國基金美元 A(acc)股    | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團   |
| 242 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列－東歐基金歐元 A(acc)股    | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團   |
| 243 | 百利達中期歐元債券基金 C 股                 | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 244 | 百利達日本小型公司基金 C 股                 | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 245 | 百利達日本小型公司基金 I 股                 | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 246 | 百利達日本小型公司基金 L 股                 | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 247 | 百利達日本基金 C 股                     | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 248 | 百利達日本基金 I 股                     | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 249 | 百利達日本基金 L 股                     | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 250 | 百利達日本基金 P 股                     | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 251 | 百利達日圓債券基金 C 股                   | 債券型  | 單一國家 | 日圓   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 252 | 百利達日圓債券基金 I 股                   | 債券型  | 單一國家 | 日圓   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 253 | 百利達日圓債券基金 L 股                   | 債券型  | 單一國家 | 日圓   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 254 | 百利達全球科技基金 C 股                   | 股票型  | 全球型  | 美元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 255 | 百利達全球資源基金 C 股                   | 股票型  | 全球型  | 美元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 256 | 百利達拉丁美洲基金 C 股                   | 股票型  | 區域型  | 美元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 257 | 百利達拉丁美洲基金 I 股                   | 股票型  | 區域型  | 美元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 258 | 百利達法國基金 C 股                     | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 259 | 百利達美元債券基金 C 股                   | 債券型  | 單一國家 | 美元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 260 | 百利達美國小型公司基金 C 股                 | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 261 | 百利達美國小型公司基金 I 股                 | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 262 | 百利達美國基金 C 股                     | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 263 | 百利達美國基金 I 股                     | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 264 | 百利達美國基金 L 股                     | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 265 | 百利達短期美元基金 C 股                   | 貨幣型  | 全球型  | 美元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 266 | 百利達短期歐元基金 C 股                   | 貨幣型  | 全球型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 267 | 百利達短期歐元基金 I 股                   | 貨幣型  | 全球型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 268 | 百利達歐元平衡增長基金 C 股                 | 平衡型  | 全球型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 269 | 百利達歐元股票基金 C 股                   | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 270 | 百利達歐元股票基金 I 股                   | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 271 | 百利達歐元債券基金 C 股                   | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 272 | 百利達歐洲中型公司基金 C 股                 | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 273 | 百利達歐洲可換股債券基金 C 股                | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 274 | 百利達歐洲可換股債券基金 I 股                | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 275 | 百利達歐洲全方位基金 C 股                  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 276 | 百利達歐洲全方位基金 I 股                  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 277 | 百利達歐洲金融股票基金 C 股                 | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 278 | 百利達歐洲高股息基金 C 股                  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 279 | 百利達歐洲高股息基金 I 股                  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 280 | 百利達歐洲高息債券基金 C 股                 | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 281 | 百利達歐洲高息債券基金 I 股                 | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 282 | 百利達歐洲債券基金 C 股                   | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 283 | 百利達歐洲債券基金 I 股                   | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 284 | 百利達歐盟匯聚基金 C 股                   | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 285 | 百利達澳洲基金 C 股                     | 股票型  | 單一國家 | 澳幣   | 法國巴黎資產管理盧森堡公司 |
| 286 | 法興日本精選增長股票基金 A 股                | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 法國興業資產管理      |
| 287 | 法興全球能源股票基金 A 股                  | 股票型  | 全球型  | 美元   | 法國興業資產管理      |
| 288 | 法興美國相關價值股票基金 A 股                | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 法國興業資產管理      |
| 289 | 法興歐元週期性股票基金 B 股                 | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國興業資產管理      |
| 290 | 法興東歐股票基金 A 股                    | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國興業資產管理      |
| 291 | 法興歐元週期性股票基金 A 股                 | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國興業資產管理      |
| 292 | 法興歐洲精選股票基金 A 股                  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國興業資產管理      |
| 293 | 法興歐元股票基金 B 股                    | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國興業資產管理      |
| 294 | 法興歐元股票基金 P 股                    | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國興業資產管理      |
| 295 | 法興歐元股票基金 A 股                    | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 法國興業資產管理      |
| 296 | 法興歐元貨幣市場基金 A 股                  | 貨幣型  | 區域型  | 歐元   | 法國興業資產管理      |
| 297 | 法興美元貨幣市場基金 A 股                  | 貨幣型  | 單一國家 | 美元   | 法國興業資產管理      |
| 298 | 荷銀日本股票基金 A                      | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 荷銀投資基金公司      |
| 299 | 荷銀全球新興市場債券基金 A                  | 債券型  | 區域型  | 美元   | 荷銀投資基金公司      |
| 300 | 荷銀全球新興市場債券基金 AH                 | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 荷銀投資基金公司      |
| 301 | 荷銀全球新興市場債券基金/配息 H               | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 荷銀投資基金公司      |
| 302 | 荷銀均衡組合基金 4A                     | 平衡型  | 全球型  | 美元   | 荷銀投資基金公司      |
| 303 | 荷銀拉丁美洲股票基金 A                    | 股票型  | 區域型  | 美元   | 荷銀投資基金公司      |
| 304 | 荷銀東歐股票基金 A                      | 股票型  | 區域型  | 美元   | 荷銀投資基金公司      |

| 項次  | 基金名稱                                | 基金種類 | 投資區域 | 計價幣別 | 發行機構        |
|-----|-------------------------------------|------|------|------|-------------|
| 305 | 荷銀金融基金 A                            | 股票型  | 全球型  | 美元   | 荷銀投資基金公司    |
| 306 | 荷銀保守組合基金 2A                         | 平衡型  | 全球型  | 美元   | 荷銀投資基金公司    |
| 307 | 荷銀美國股票增長基金 A                        | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 荷銀投資基金公司    |
| 308 | 荷銀美國股票增長基金/配息                       | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 荷銀投資基金公司    |
| 309 | 荷銀能源基金 A                            | 股票型  | 全球型  | 美元   | 荷銀投資基金公司    |
| 310 | 荷銀能源基金/配息                           | 股票型  | 全球型  | 美元   | 荷銀投資基金公司    |
| 311 | 荷銀能源基金/配息                           | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 荷銀投資基金公司    |
| 312 | 荷銀高收益債券基金 A                         | 債券型  | 全球型  | 歐元   | 荷銀投資基金公司    |
| 313 | 荷銀高收益債券基金/配息                        | 債券型  | 全球型  | 歐元   | 荷銀投資基金公司    |
| 314 | 荷銀健康護理基金 A                          | 股票型  | 全球型  | 美元   | 荷銀投資基金公司    |
| 315 | 荷銀健康護理基金 A                          | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 荷銀投資基金公司    |
| 316 | 荷銀溫和組合基金 3A                         | 平衡型  | 全球型  | 美元   | 荷銀投資基金公司    |
| 317 | 荷銀資訊科技基金 A                          | 股票型  | 全球型  | 美元   | 荷銀投資基金公司    |
| 318 | 荷銀資訊科技基金 A                          | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 荷銀投資基金公司    |
| 319 | 荷銀歐洲小型企業股票基金 A                      | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 荷銀投資基金公司    |
| 320 | 荷銀歐洲股票基金 A                          | 股票型  | 區域型  | 美元   | 荷銀投資基金公司    |
| 321 | 荷銀歐洲股票基金 A                          | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 荷銀投資基金公司    |
| 322 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—全球股票收益基金美元 A(Qdis)股   | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 323 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—歐洲基金歐元 A(acc)股        | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 324 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—歐元全球基金歐元 A(Ydis)股     | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 325 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—中小型企業基金美元 A(Ydis)股    | 股票型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 326 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—歐洲基金美元 A(Ydis)股       | 股票型  | 區域型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 327 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—潛力歐洲基金歐元 A(acc)股      | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 328 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—全球平衡基金美元 A(Qdis)股     | 平衡型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 329 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—全球平衡基金美元 B(acc)股      | 平衡型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 330 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—全球債券基金美元 A(acc)股      | 債券型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 331 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—全球債券基金歐元 A(Mdis)股     | 債券型  | 全球型  | 歐元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 332 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—全球債券基金美元 B(Mdis)股     | 債券型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 333 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—全球債券基金美元 A(Mdis)股     | 債券型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 334 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—美國政府基金美元 A(Mdis)股     | 債券型  | 單一國家 | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 335 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—新興國家固定收益基金美元 A(Qdis)股 | 債券型  | 區域型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 336 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—公司債基金美元 A(Mdis)股      | 債券型  | 全球型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 337 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—新興國家固定收益基金美元 B(Qdis)股 | 債券型  | 區域型  | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 338 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—美國政府基金美元 B(Mdis)股     | 債券型  | 單一國家 | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 339 | 富蘭克林坦伯頓全球投資系列—公司債基金美元 B(Mdis)股      | 債券型  | 單一國家 | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 340 | 富蘭克林潛力組合基金 A 股                      | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 341 | 富蘭克林高成長基金 A 股                       | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 富蘭克林坦伯頓基金集團 |
| 342 | 景順日本小型企業基金 A                        | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 景順投資管理有限公司  |
| 343 | 景順日本企業基金 A                          | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 景順投資管理有限公司  |
| 344 | 景順日本基金 A                            | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 景順投資管理有限公司  |
| 345 | 景順日本增長基金 A                          | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 景順投資管理有限公司  |
| 346 | 景順日本增長基金 B                          | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 景順投資管理有限公司  |
| 347 | 景順全歐洲企業基金 A                         | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 景順投資管理有限公司  |
| 348 | 景順泛歐洲基金 A                           | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 景順投資管理有限公司  |
| 349 | 景順科技基金 A                            | 股票型  | 全球型  | 美元   | 景順投資管理有限公司  |
| 350 | 景順英國動力基金 A                          | 股票型  | 單一國家 | 英鎊   | 景順投資管理有限公司  |
| 351 | 景順能源基金 A                            | 股票型  | 全球型  | 美元   | 景順投資管理有限公司  |
| 352 | 景順健康護理基金 A                          | 股票型  | 全球型  | 美元   | 景順投資管理有限公司  |
| 353 | 景順策略債券基金 A                          | 債券型  | 全球型  | 美元   | 景順投資管理有限公司  |
| 354 | 景順債券基金 A                            | 債券型  | 全球型  | 美元   | 景順投資管理有限公司  |

| 項次  | 基金名稱                  | 基金種類 | 投資區域 | 計價幣別 | 發行機構              |
|-----|-----------------------|------|------|------|-------------------|
| 355 | 景順歐洲動力基金 A            | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 景順投資管理有限公司        |
| 356 | 景順歐洲債券基金 A            | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 景順投資管理有限公司        |
| 357 | 匯豐環球投資基金－歐洲股票         | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 匯豐投資基金(盧森堡)股份有限公司 |
| 358 | 匯豐環球投資基金－歐元區股票        | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 匯豐投資基金(盧森堡)股份有限公司 |
| 359 | 匯豐環球投資基金－環球精選債券       | 債券型  | 全球型  | 美元   | 匯豐投資基金(盧森堡)股份有限公司 |
| 360 | 匯豐環球投資基金－泰國股票         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 匯豐投資基金(盧森堡)股份有限公司 |
| 361 | 匯豐環球投資基金－印度股票         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 匯豐投資基金(盧森堡)股份有限公司 |
| 362 | 匯豐環球投資基金－英國股票         | 股票型  | 單一國家 | 英鎊   | 匯豐投資基金(盧森堡)股份有限公司 |
| 363 | 匯豐環球投資基金－美國股票         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 匯豐投資基金(盧森堡)股份有限公司 |
| 364 | 新加坡大華日本成長基金(美元)       | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 新加坡大華資產管理公司       |
| 365 | 新加坡大華全球保健基金(美元)       | 股票型  | 全球型  | 美元   | 新加坡大華資產管理公司       |
| 366 | 新加坡大華全球科技基金(美元)       | 股票型  | 全球型  | 美元   | 新加坡大華資產管理公司       |
| 367 | 新加坡大華全球資本基金(美元)       | 股票型  | 全球型  | 美元   | 新加坡大華資產管理公司       |
| 368 | 新加坡大華成長基金(美元)         | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 新加坡大華資產管理公司       |
| 369 | 新加坡大華投資基金(美元)         | 股票型  | 區域型  | 美元   | 新加坡大華資產管理公司       |
| 370 | 新加坡大華區域成長基金(美元)       | 股票型  | 區域型  | 美元   | 新加坡大華資產管理公司       |
| 371 | 新加坡大華國際成長基金(美元)       | 股票型  | 全球型  | 美元   | 新加坡大華資產管理公司       |
| 372 | 新加坡大華歐洲股票基金(美元)       | 股票型  | 區域型  | 美元   | 新加坡大華資產管理公司       |
| 373 | 瑞士信貸歐洲藍籌股票基金          | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 瑞士信貸資產管理          |
| 374 | 瑞士信貸全球資源股票基金          | 股票型  | 全球型  | 美元   | 瑞士信貸資產管理          |
| 375 | 瑞士信貸美國股票基金            | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 瑞士信貸資產管理          |
| 376 | 瑞士信貸日本大趨勢股票基金         | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 瑞士信貸資產管理          |
| 377 | 瑞士信貸全球資訊科技股票基金        | 股票型  | 全球型  | 美元   | 瑞士信貸資產管理          |
| 378 | 瑞士信貸美元貨幣基金            | 貨幣型  | 全球型  | 美元   | 瑞士信貸資產管理          |
| 379 | 瑞士信貸歐元貨幣基金            | 貨幣型  | 全球型  | 歐元   | 瑞士信貸資產管理          |
| 380 | 瑞士信貸歐元債券基金            | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 瑞士信貸資產管理          |
| 381 | 瑞士信貸美元債券基金            | 債券型  | 單一國家 | 美元   | 瑞士信貸資產管理          |
| 382 | 瑞銀(盧森堡)美國價值投資股票基金     | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 瑞銀股票基金管理股份有限公司    |
| 383 | 瑞銀(盧森堡)中歐股票基金         | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 瑞銀股票基金管理股份有限公司    |
| 384 | 瑞銀(盧森堡)日本中小型股票基金      | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 瑞銀股票基金管理股份有限公司    |
| 385 | 瑞銀(盧森堡)日本股票基金         | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 瑞銀股票基金管理股份有限公司    |
| 386 | 瑞銀(盧森堡)加拿大股票基金        | 股票型  | 單一國家 | 加幣   | 瑞銀股票基金管理股份有限公司    |
| 387 | 瑞銀(盧森堡)生化股票基金         | 股票型  | 全球型  | 美元   | 瑞銀股票基金管理股份有限公司    |
| 388 | 瑞銀(盧森堡)保健股票基金         | 股票型  | 全球型  | 美元   | 瑞銀股票基金管理股份有限公司    |
| 389 | 瑞銀(盧森堡)美國小型股票基金       | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 瑞銀股票基金管理股份有限公司    |
| 390 | 瑞銀(盧森堡)歐洲中型股票基金       | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 瑞銀股票基金管理股份有限公司    |
| 391 | 瑞銀(盧森堡)加幣基金           | 貨幣型  | 全球型  | 加幣   | 瑞銀貨幣市場基金管理股份有限公司  |
| 392 | 瑞銀(盧森堡)美元基金           | 貨幣型  | 全球型  | 美元   | 瑞銀貨幣市場基金管理股份有限公司  |
| 393 | 瑞銀(盧森堡)英鎊基金           | 貨幣型  | 全球型  | 英鎊   | 瑞銀貨幣市場基金管理股份有限公司  |
| 394 | 瑞銀(盧森堡)歐元基金           | 貨幣型  | 全球型  | 歐元   | 瑞銀貨幣市場基金管理股份有限公司  |
| 395 | 瑞銀(盧森堡)澳幣基金           | 貨幣型  | 全球型  | 澳幣   | 瑞銀貨幣市場基金管理股份有限公司  |
| 396 | 瑞銀(盧森堡)美元高收益債券基金      | 債券型  | 全球型  | 美元   | 瑞銀債券基金管理股份有限公司    |
| 397 | 瑞銀(盧森堡)美元債券基金         | 債券型  | 全球型  | 美元   | 瑞銀債券基金管理股份有限公司    |
| 398 | 瑞銀(盧森堡)歐元高收益債券基金      | 債券型  | 全球型  | 歐元   | 瑞銀債券基金管理股份有限公司    |
| 399 | 瑞銀(盧森堡)歐元債券基金         | 債券型  | 全球型  | 歐元   | 瑞銀債券基金管理股份有限公司    |
| 400 | 瑞銀(盧森堡)新興市場債券基金       | 債券型  | 區域型  | 美元   | 瑞銀新興市場基金管理股份有限公司  |
| 401 | 瑞銀(盧森堡)新興市場債券基金－美元 AM | 債券型  | 區域型  | 美元   | 瑞銀新興市場基金管理股份有限公司  |
| 402 | 瑞銀(盧森堡)全球戰略配置精選基金(美元) | 平衡型  | 全球型  | 美元   | 瑞銀(盧森堡)精選管理基金公司   |
| 403 | 瑞銀(盧森堡)全球戰略配置精選基金(歐元) | 平衡型  | 全球型  | 歐元   | 瑞銀(盧森堡)精選管理基金公司   |
| 404 | 瑞銀(盧森堡)策略基金－平衡型(美元)   | 平衡型  | 全球型  | 美元   | 瑞銀策略基金管理股份有限公司    |
| 405 | 瑞銀(盧森堡)策略基金－平衡型(歐元)   | 平衡型  | 全球型  | 歐元   | 瑞銀策略基金管理股份有限公司    |
| 406 | 瑞銀(盧森堡)策略基金－增長型(美元)   | 股票型  | 全球型  | 美元   | 瑞銀策略基金管理股份有限公司    |
| 407 | 瑞銀(盧森堡)策略基金－增長型(歐元)   | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 瑞銀策略基金管理股份有限公司    |
| 408 | 瑞銀(盧森堡)策略基金－固定收益型(美元) | 債券型  | 全球型  | 美元   | 瑞銀策略基金管理股份有限公司    |
| 409 | 瑞銀(盧森堡)策略基金－固定收益型(歐元) | 債券型  | 全球型  | 歐元   | 瑞銀策略基金管理股份有限公司    |
| 410 | 瑞銀(盧森堡)策略基金－股票型(歐元)   | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 瑞銀策略基金管理股份有限公司    |
| 411 | 瑞銀(盧森堡)策略基金－收益型(美元)   | 平衡型  | 全球型  | 美元   | 瑞銀策略基金管理股份有限公司    |
| 412 | 瑞銀(盧森堡)策略基金－收益型(歐元)   | 平衡型  | 全球型  | 歐元   | 瑞銀策略基金管理股份有限公司    |
| 413 | 聯博－全球平衡型基金 B 股美元      | 平衡型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司          |
| 414 | 聯博－全球成長趨勢基金 A 股美元     | 股票型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司          |
| 415 | 聯博－全球成長趨勢基金 A 股歐元     | 股票型  | 全球型  | 歐元   | 聯博資產管理公司          |
| 416 | 聯博－全球成長趨勢基金 B 股美元     | 股票型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司          |
| 417 | 聯博－全球成長趨勢基金 I 股美元     | 股票型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司          |
| 418 | 聯博－全球保守型基金 B2 股美元     | 股票型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司          |
| 419 | 聯博－全球高收益債券基金 A2 股美元   | 債券型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司          |
| 420 | 聯博－全球高收益債券基金 AT 股美元   | 債券型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司          |
| 421 | 聯博－全球高收益債券基金 BT 股美元   | 債券型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司          |

| 項次  | 基金名稱                              | 基金種類 | 投資區域 | 計價幣別 | 發行機構         |
|-----|-----------------------------------|------|------|------|--------------|
| 422 | 聯博－全球價值型基金 A 股美元                  | 股票型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 423 | 聯博－全球複合型股票基金 A 股美元                | 股票型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 424 | 聯博－印度成長基金 A 股美元                   | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 425 | 聯博－美國成長基金 A 股美元                   | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 426 | 聯博－美國收益基金 A2 股美元                  | 債券型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 427 | 聯博－美國收益基金 AT 股美元                  | 債券型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 428 | 聯博－美國收益基金 A 股美元                   | 債券型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 429 | 聯博－美國收益基金 BT 股美元                  | 債券型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 430 | 聯博－美國收益基金 B 股美元                   | 債券型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 431 | 聯博－國際科技基金 A 股美元                   | 股票型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 432 | 聯博－國際醫療基金 A 股美元                   | 股票型  | 全球型  | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 433 | 聯博－新興市場成長基金 A 股美元                 | 股票型  | 區域型  | 美元   | 聯博資產管理公司     |
| 434 | 聯博－歐洲價值型基金 A 股歐元                  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 聯博資產管理公司     |
| 435 | 紐約銀行邁倫全球債券基金 A EUR                | 債券型  | 全球型  | 歐元   | 紐約銀行邁倫資產管理公司 |
| 436 | 紐約銀行邁倫全球債券基金 A USD                | 債券型  | 全球型  | 美元   | 紐約銀行邁倫資產管理公司 |
| 437 | 施羅德環球基金系列－日本小型公司 A1 類股份－累積單位      | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 438 | 施羅德環球基金系列－日本小型公司(美元)A1 類股份－累積單位   | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 439 | 施羅德環球基金系列－日本小型公司(歐元)A1 類股份－累積單位   | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 440 | 施羅德環球基金系列－日本股票 A1 類股份－累積單位        | 股票型  | 單一國家 | 日圓   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 441 | 施羅德環球基金系列－北美洲宏觀股票 A1 類股份－累積單位     | 股票型  | 區域型  | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 442 | 施羅德環球基金系列－亞洲債券 A1 類股份－累積單位        | 債券型  | 區域型  | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 443 | 施羅德環球基金系列－亞洲債券 B1 類股份－累積單位        | 債券型  | 區域型  | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 444 | 施羅德環球基金系列－亞洲債券(歐元)A1 類股份－累積單位     | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 445 | 施羅德環球基金系列－拉丁美洲 A1 類股份－累積單位        | 股票型  | 區域型  | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 446 | 施羅德環球基金系列－拉丁美洲(歐元)A1 類股份－累積單位     | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 447 | 施羅德環球基金系列－美元流動 A 類股份－累積單位         | 貨幣型  | 單一國家 | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 448 | 施羅德環球基金系列－美元債券 A1 類股份－累積單位        | 債券型  | 單一國家 | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 449 | 施羅德環球基金系列－美國大型股 A1 類股份－累積單位       | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 450 | 施羅德環球基金系列－美國小型公司 A1 類股份－累積單位      | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 451 | 施羅德環球基金系列－英國股票 A1 類股份－累積單位        | 股票型  | 單一國家 | 英鎊   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 452 | 施羅德環球基金系列－新興市場債券 A1 類股份－累積單位      | 債券型  | 區域型  | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 453 | 施羅德環球基金系列－新興市場債券(歐元對沖)A1 類股份－累積單位 | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 454 | 施羅德環球基金系列－新興亞洲 A1 類股份－累積單位        | 股票型  | 區域型  | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 455 | 施羅德環球基金系列－新興亞洲(歐元)A1 類股份－累積單位     | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 456 | 施羅德環球基金系列－新興歐洲 A1 類股份－累積單位        | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 457 | 施羅德環球基金系列－新興歐洲(美元)A1 類股份－累積單位     | 股票型  | 區域型  | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 458 | 施羅德環球基金系列－新興歐洲債券 A1 類股份－累積單位      | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 459 | 施羅德環球基金系列－新興歐洲債券(美元)A1 類股份－累積單位   | 債券型  | 區域型  | 美元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 460 | 施羅德環球基金系列－瑞士中小型股票 A1 類股份－累積單位     | 股票型  | 單一國家 | 瑞士法郎 | 施羅德投資管理有限公司  |
| 461 | 施羅德環球基金系列－瑞士股票 A1 類股份－累積單位        | 股票型  | 單一國家 | 瑞士法郎 | 施羅德投資管理有限公司  |
| 462 | 施羅德環球基金系列－義大利股票 A1 類股份－累積單位       | 股票型  | 單一國家 | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 463 | 施羅德環球基金系列－歐元企業債券 A1 類股份－累積單位      | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 464 | 施羅德環球基金系列－歐元企業債券 B1 類股份－累積單位      | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 465 | 施羅德環球基金系列－歐元股票 A1 類股份－累積單位        | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 466 | 施羅德環球基金系列－歐元流動 A 類股份－累積單位         | 貨幣型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 467 | 施羅德環球基金系列－歐元動力增長 A1 類股份－累積單位      | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 468 | 施羅德環球基金系列－歐元短期債券 A1 類股份－累積單位      | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 469 | 施羅德環球基金系列－歐元債券 A1 類股份－累積單位        | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |
| 470 | 施羅德環球基金系列－歐元增值 A1 類股份－累積單位        | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司  |

| 項次  | 基金名稱  | 基金種類 | 投資區域 | 計價幣別 | 發行機構                                       |
|-----|---|------|------|------|--|
| 471 | 施羅德環球基金系列－歐洲大型股 A1 類股份－累積單位                                 | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司                                |
| 472 | 施羅德環球基金系列－歐洲小型公司 A1 類股份－累積單位                                | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司                                |
| 473 | 施羅德環球基金系列－歐洲小型公司(美元)A1 類股份－累積單位                             | 股票型  | 區域型  | 美元   | 施羅德投資管理有限公司                                |
| 474 | 施羅德環球基金系列－歐洲目標回報 A1 類股份－累積單位                                | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司                                |
| 475 | 施羅德環球基金系列－歐洲收益股票 A1 類股份－累積單位                                | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司                                |
| 476 | 施羅德環球基金系列－歐洲進取股票 A1 類股份－累積單位                                | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司                                |
| 477 | 施羅德環球基金系列－歐洲債券 A1 類股份－累積單位                                  | 債券型  | 區域型  | 歐元   | 施羅德投資管理有限公司                                |
| 478 | 施羅德環球基金系列－環球宏觀股票 A1 類股份－累積單位                                | 股票型  | 全球型  | 美元   | 施羅德投資管理有限公司                                |
| 479 | 施羅德環球基金系列－環球債券 A1 類股份－累積單位                                  | 債券型  | 全球型  | 美元   | 施羅德投資管理有限公司                                |
| 480 | 霸菱全球新興市場基金美元  | 股票型  | 區域型  | 美元   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 481 | 霸菱全球資源基金美元  | 股票型  | 全球型  | 美元   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 482 | 霸菱拉丁美洲基金美元  | 股票型  | 區域型  | 美元   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 483 | 霸菱東歐基金美元  | 股票型  | 區域型  | 美元   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 484 | 霸菱東歐基金歐元  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 485 | 霸菱高收益債券基金－美元季配  | 債券型  | 全球型  | 美元   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 486 | 霸菱歐寶基金美元  | 股票型  | 區域型  | 美元   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 487 | 霸菱歐寶基金歐元  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 488 | 霸菱澳洲基金  | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 489 | 霸菱韓國基金  | 股票型  | 單一國家 | 美元   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 490 | 霸菱歐洲精選信託基金  | 股票型  | 區域型  | 歐元   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 491 | 霸菱英鎊全球債券信託基金  | 債券型  | 全球型  | 英鎊   | 霸菱資產管理公司                                   |
| 492 | MSCI 新興市場指數基金<br>(iShares MSCI Emerging Markets Index Fund) | 股票型  | 區域型  | 美元   | 柏克萊國際投資管理公司<br>(Barclays Global Investors) |

III、可連結之股票標的如下：

| 項次  | 股票名稱                              | 項次  | 股票名稱                         | 項次  | 股票名稱                                     |
|-----|-----------------------------------|-----|------------------------------|-----|--|
| 1   | 3COM CORP                         | 2   | 3I GROUP PLC                 | 3   | 3I INFRASTRUCTURE LTD                    |
| 4   | 3M CO                             | 5   | 77 BANK LTD/THE              | 6   | A P MOLLER - MAERSK A/S                  |
| 7   | A2A SPA                           | 8   | AAR CORP                     | 9   | AARE-TESSIN AG ELEKTRIZITAT              |
| 10  | ABB GRAIN LIMITED                 | 11  | ABB LTD/INDIA                | 12  | ABB LTD-REG                              |
| 13  | ABBOTT LABORATORIES               | 14  | ABC LEARNING CENTRES LTD     | 15  | ABC-MART INC                             |
| 16  | ABENGOA SA                        | 17  | ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A  | 18  | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA              |
| 19  | ABITIBIBOWATER INC                | 20  | ABN AMRO HOLDING NV          | 21  | ABOU KIR FERTILIZERS & CHEMICAL INDUSTRI |
| 22  | ABRAXIS BIOSCIENCE INC            | 23  | ABSA GROUP LTD               | 24  | ABU DHABI COMMERCIAL BANK                |
| 25  | ABU DHABI NATIONAL HOTELS         | 26  | ACC LTD                      | 27  | ACCENTURE LTD-CL A                       |
| 28  | ACCESS CO LTD                     | 29  | ACCIONA SA                   | 30  | ACCOR SA                                 |
| 31  | ACE AVIATION HOLDINGS INC-B       | 32  | ACE LTD                      | 33  | ACERGY SA                                |
| 34  | ACERINOX SA                       | 35  | ACOM CO LTD                  | 36  | ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV              |
| 37  | ACTELION LTD-REG                  | 38  | ACTIVISION INC               | 39  | ACTUANT CORP-CL A                        |
| 40  | ACUITY BRANDS INC                 | 41  | ADAMS RESPIRATORY THERA INC  | 42  | ADANI ENTERPRISES LTD                    |
| 43  | ADC TELECOMMUNICATIONS INC        | 44  | ADDAX PETROLEUM CORP         | 45  | ADECCO SA-REG                            |
| 46  | ADELAIDE BRIGHTON LIMITED         | 47  | ADIDAS AG                    | 48  | ADMIRAL GROUP PLC                        |
| 49  | ADOBE SYSTEMS INC                 | 50  | ADP                          | 51  | ADTRAN INC                               |
| 52  | ADVANCE AUTO PARTS INC            | 53  | ADVANCED INFO SERVICE PCL    | 54  | ADVANCED MEDICAL OPTICS                  |
| 55  | ADVANCED METALLURGICAL GROUP NV   | 56  | ADVANCED MICRO DEVICES       | 57  | ADVANTAGE ENERGY INCOME FUND             |
| 58  | ADVANTEST CORP                    | 59  | ADVENT SOFTWARE INC          | 60  | ADVISORY BOARD CO/THE                    |
| 61  | AECOM TECHNOLOGY CORP             | 62  | AEGEAN MARINE PETROLEUM NETW | 63  | AEGIS GROUP PLC                          |
| 64  | AEON CO LTD                       | 65  | AEON CREDIT SERVICE CO LTD   | 66  | AEON MALL CO LTD                         |
| 67  | AERCAP HOLDINGS NV                | 68  | AEROPLAN INCOME FUND         | 69  | AEROPORTS DE PARIS                       |
| 70  | AEROPOSTALE INC                   | 71  | AES CORP                     | 72  | AETNA INC                                |
| 73  | AFFILIATED COMPUTER SVCS-A        | 74  | AFFILIATED MANAGERS GROUP    | 75  | AFFIN HOLDINGS BERHAD                    |
| 76  | AFFYMETRIX INC                    | 77  | AFLAC INC                    | 78  | AFRICA ISRAEL INVESTMENTS LTD            |
| 79  | AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD      | 80  | AGCO CORP                    | 81  | AGF MANAGEMENT LTD-CL B                  |
| 82  | AGGREKO PLC                       | 83  | AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 84  | AGL ENERGY LTD                           |
| 85  | AGL RESOURCES INC                 | 86  | AGNICO-EAGLE MINES           | 87  | AGRIUM INC                               |
| 88  | AGUAS ANDINAS SA                  | 89  | AGUAS DE BARCELONA-CLASS A   | 90  | AHLI UNITED BANK                         |
| 91  | AIFUL CORP                        | 92  | AIOI INSURANCE CO LTD        | 93  | AIR FRANCE-KLM                           |
| 94  | AIR LIQUIDE                       | 95  | AIR NEW ZEALAND LTD          | 96  | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC             |
| 97  | AIR WATER INC                     | 98  | AIRASIA BHD                  | 99  | AIRCATTLE LTD                            |
| 100 | AIRGAS INC                        | 101 | AIRPORTS OF THAILAND PCL     | 102 | AISIN SEIKI CO LTD                       |
| 103 | AIXTRON AG-SPONSORED ADR          | 104 | AJINOMOTO CO INC             | 105 | AK STEEL HOLDING CORP                    |
| 106 | AKAMAI TECHNOLOGIES               | 107 | AKBANK TAS                   | 108 | AKER KVAERNER                            |
| 109 | AKRUTI CITY LTD                   | 110 | AKZO NOBEL                   | 111 | AL ABDULLATIF INDUSTRIAL INVESTMENT CO   |
| 112 | AL RAJHI BANK                     | 113 | ALABAMA NATIONAL BANCORP/DEL | 114 | ALBANY INTL CORP-CL A                    |
| 115 | ALBEMARLE CORP                    | 116 | ALBERTO-CULVER CO            | 117 | ALCATEL-LUCENT                           |
| 118 | ALCHEVSKIY METALURGIYNIY KOMBINAT | 119 | ALCOA INC                    | 120 | ALCON INC                                |
| 121 | ALDAR PROPERTIES PJSC             | 122 | ALEXANDER & BALDWIN INC      | 123 | ALEXANDER'S INC                          |
| 124 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT      | 125 | ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 126 | ALFA CORPORATION                         |
| 127 | ALFA LAVAL AB                     | 128 | ALFRED MCALPINE PLC          | 129 | ALFRESA HOLDINGS CORP                    |
| 130 | ALIMENTATION COUCHE-TARD -B       | 131 | ALKERMES INC                 | 132 | ALL AMERICA LATINA LOGISTICA SA          |
| 133 | ALL NIPPON AIRWAYS CO LTD         | 134 | ALLCO FINANCE GROUP LTD      | 135 | ALLEANZA ASSICURAZIONI                   |
| 136 | ALLEGHANY CORP                    | 137 | ALLEGHENY ENERGY INC         | 138 | ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC               |
| 139 | ALLERGAN INC                      | 140 | ALLETE INC                   | 141 | ALLGREEN PROPERTIES LTD                  |
| 142 | ALLIANCE & LEICESTER PLC          | 143 | ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 144 | ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD             |
| 145 | ALLIANCE GLOBAL GROUP INC         | 146 | ALLIANCE HOLDINGS GP LP      | 147 | ALLIANCE RESOURCE PARTNERS               |
| 148 | ALLIANT ENERGY CORP               | 149 | ALLIANT TECHSYSTEMS INC      | 150 | ALLIANZ LEBENSVERSICHERUNGS-AG           |
| 151 | ALLIANZ SE-REG                    | 152 | ALLIED CAPITAL CORP          | 153 | ALLIED IRISH BANKS PLC                   |
| 154 | ALLIED IRISH BANKS-SPONS ADR      | 155 | ALLIED WASTE INDUSTRIES INC  | 156 | ALLIED WORLD ASSURANCE CO                |
| 157 | ALLREAL HOLDING AG                | 158 | ALLSTATE CORP                | 159 | ALMACENES EXITO SA                       |
| 160 | ALMARAI CO LTD                    | 161 | ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 162 | ALPHA BANK A.E.                          |
| 163 | ALPHA NATURAL RESOURCES INC       | 164 | ALPS ELECTRIC CO LTD         | 165 | AL-QURAIN PETROCHEMICALS CO              |
| 166 | ALRO SA                           | 167 | ALSTOM                       | 168 | ALTADIS SA                               |
| 169 | ALTAGAS INCOME TRUST              | 170 | ALTANA AG                    | 171 | ALTAREA                                  |
| 172 | ALTERA CORPORATION                | 173 | ALTRIA GROUP INC             | 174 | ALUAR ALUMINIO ARGENTINO SAIC            |
| 175 | ALUMINA LTD                       | 176 | AMADA CO LTD                 | 177 | AMAZON.COM INC                           |
| 178 | AMB GENERALI HOLDING AG           | 179 | AMB PROPERTY CORP            | 180 | AMBAC FINANCIAL GROUP INC                |
| 181 | AMBUJA CEMENTS LTD                | 182 | AMCOR LTD                    | 183 | AMDOCS LTD                               |
| 184 | AMEC PLC                          | 185 | AMEDISYS INC                 | 186 | AMER SPORTS OYJ                          |
| 187 | AMERCO                            | 188 | AMEREN CORPORATION           | 189 | AMERICA MOVIL SAB DE CV                  |

| 項次  | 股票名稱                                      | 項次  | 股票名稱                                     | 項次  | 股票名稱                          |
|-----|---|-----|--|-----|-------------------------------|
| 190 | AMERICAN AXLE &                           | 191 | AMERICAN CAPITAL STRATEGIES              | 192 | AMERICAN EAGLE OUTFITTERS     |
| 193 | AMERICAN ELECTRIC POWER                   | 194 | AMERICAN EXPRESS CO                      | 195 | AMERICAN FINANCIAL GROUP INC  |
| 196 | AMERICAN FINANCIAL REALTY TR              | 197 | AMERICAN GREETINGS CORP-CL A             | 198 | AMERICAN INTERNATIONAL        |
| 199 | AMERICAN NATIONAL INSURANCE               | 200 | AMERICAN TOWER CORP-CL A                 | 201 | AMERICREDIT CORP              |
| 202 | AMERIGROUP CORP                           | 203 | AMERIPRISE FINANCIAL INC                 | 204 | AMERISOURCEBERGEN CORP        |
| 205 | AMERISTAR CASINOS INC                     | 206 | AMETEK INC                               | 207 | AMGEN INC                     |
| 208 | AMKOR TECHNOLOGY INC                      | 209 | AMLIN PLC                                | 210 | AMMB HOLDINGS BHD             |
| 211 | AMOREPACIFIC CORP                         | 212 | AMP LTD                                  | 213 | AMPHENOL CORP-CL A            |
| 214 | AMR CORP                                  | 215 | AMTEK AUTO LTD                           | 216 | AMYLIN PHARMACEUTICALS INC    |
| 217 | ANADARKO PETROLEUM CORP                   | 218 | ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII A | 219 | ANALOG DEVICES                |
| 220 | ANANT RAJ INDUSTRIES LTD                  | 221 | ANDRITZ AG                               | 222 | ANEKA TAMBANG TBK PT          |
| 223 | ANGLO AMERICAN PLC                        | 224 | ANGLO AMERICAN PLC-UNSP ADR              | 225 | ANGLO IRISH BANK CORP PLC     |
| 226 | ANGLO PLATINUM LTD                        | 227 | ANGLOGOLD ASHANTI LTD                    | 228 | ANGLOGOLD ASHANTI-SPON ADR    |
| 229 | ANHEUSER-BUSCH COS INC.                   | 230 | ANIXTER INTERNATIONAL INC                | 231 | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN  |
| 232 | ANNTAYLOR STORES CORP                     | 233 | ANSELL LTD                               | 234 | ANSYS INC                     |
| 235 | ANTARCHILE SA                             | 236 | ANTENA 3 TELEVISION                      | 237 | ANTOFAGASTA PLC               |
| 238 | AON CORP                                  | 239 | AOYAMA TRADING CO LTD                    | 240 | AOZORA BANK LTD               |
| 241 | APA GROUP                                 | 242 | APACHE CORP                              | 243 | APARTMENT INVT & MGMT CO -A   |
| 244 | APN NEWS & MEDIA LIMITED                  | 245 | APOLLO GROUP INC-CL A                    | 246 | APOLLO INVESTMENT CORP        |
| 247 | APP PHARMACEUTICALS INC                   | 248 | APPLE INC                                | 249 | APPLERA CORP - CELERA GROUP   |
| 250 | APPLIED BIOSYSTEMS GROUP                  | 251 | APPLIED INDUSTRIAL TECH INC              | 252 | APPLIED MATERIALS INC         |
| 253 | APTARGROUP INC                            | 254 | AQUA AMERICA INC                         | 255 | AQUARIUS PLATINUM LIMITED     |
| 256 | AQUILA INC                                | 257 | ARAB BANK                                | 258 | ARAB NATIONAL BANK            |
| 259 | ARAB POTASH CO                            | 260 | ARABIAN CEMENT                           | 261 | ARACRUZ CELULOSE SA           |
| 262 | ARACRUZ CELULOSE SA-SPON ADR              | 263 | ARBITRON INC                             | 264 | ARC ENERGY TRUST-UNITS        |
| 265 | ARCADIS NV                                | 266 | ARCANDOR AG                              | 267 | ARCELIK                       |
| 268 | ARCELOR MITTAL                            | 269 | ARCELORMITTAL INOX BRASIL SA             | 270 | ARCELORMITTAL-NY REGISTERED   |
| 271 | ARCH CAPITAL GROUP LTD                    | 272 | ARCH COAL INC                            | 273 | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO     |
| 274 | ARENA RESOURCES INC                       | 275 | AREVA SA                                 | 276 | AREVA T&D INDIA LTD           |
| 277 | ARGO GROUP INTERNATIONAL                  | 278 | ARISTOCRAT LEISURE LTD                   | 279 | ARKEMA                        |
| 280 | ARM HOLDINGS PLC                          | 281 | ARMSTRONG WORLD INDUSTRIES INC           | 282 | ARRIS GROUP INC               |
| 283 | ARRIVA PLC                                | 284 | ARROW ELECTRONICS INC                    | 285 | ARROW ENERGY LTD              |
| 286 | ARTHROCARE CORP                           | 287 | ARTHUR J GALLAGHER & CO                  | 288 | ARUZE CORP                    |
| 289 | ASAHI BREWERIES LTD                       | 290 | ASAHI GLASS CO LTD                       | 291 | ASAHI KASEI CORP              |
| 292 | ASAHI SOFT DRINKS CO LTD                  | 293 | ASATSU-DK INC                            | 294 | ASCIANO GROUP                 |
| 295 | ASCOTT GROUP LTD/THE                      | 296 | ASE TEST LIMITED                         | 297 | ASEER                         |
| 298 | ASHLAND INC                               | 299 | ASHMORE GROUP PLC.                       | 300 | ASIAN PAINTS LTD              |
| 301 | ASICS CORP                                | 302 | ASM INTERNATIONAL N.V.                   | 303 | ASML HOLDING NV               |
| 304 | ASPEN INSURANCE HOLDINGS LTD              | 305 | ASPEN TECHNOLOGY INC                     | 306 | ASSA ABLOY AB-B               |
| 307 | ASSICURAZIONI GENERALI                    | 308 | ASSOCIATED BANC-CORP                     | 309 | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC  |
| 310 | ASSURANT INC                              | 311 | ASSURED GUARANTY LTD                     | 312 | ASTELLAS PHARMA INC           |
| 313 | ASTORIA FINANCIAL CORP                    | 314 | ASTRA AGRO LESTARI TBK PT                | 315 | ASTRAL MEDIA INC              |
| 316 | ASTRAZENECA PLC                           | 317 | ASTRO ALL ASIA NETWORKS PLC              | 318 | ASX LTD                       |
| 319 | AT&T INC                                  | 320 | ATCO LTD -CL T'                          | 321 | ATEL HOLDING AG               |
| 322 | ATHENAHEALTH INC                          | 323 | ATLANTIA SPA                             | 324 | ATLAS AIR WORLDWIDE HOLDINGS  |
| 325 | ATLAS AMERICA INC                         | 326 | ATLAS COPCO AB-A SHS                     | 327 | ATMEL CORP                    |
| 328 | ATMOS ENERGY CORP                         | 329 | ATOS ORIGIN SA                           | 330 | ATP OIL & GAS CORPORATION     |
| 331 | ATRIUM LJUNGBERG AB                       | 332 | ATTIJARIWAFI BANK                        | 333 | ATWOOD OCEANICS INC           |
| 334 | AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD        | 335 | AUDI AG                                  | 336 | AUST AND NZ BANKING GROUP     |
| 337 | AUSTAR COMMUNICATIONS UNITED              | 338 | AUSTEVOLL SEAFOOD ASA                    | 339 | AUSTRALAND PROPERTY GROUP     |
| 340 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD | 341 | AUSTRALIAN WORLDWIDE EXPLORA             | 342 | AUTODESK INC                  |
| 343 | AUTOGRILL SPA                             | 344 | AUTOLIV INC                              | 345 | AUTOMATIC DATA PROCESSING     |
| 346 | AUTONATION INC                            | 347 | AUTONOMY CORP PLC                        | 348 | AUTOSTRADA TORINO-MILANO SPA  |
| 349 | AUTOZONE INC                              | 350 | AUXILIUM PHARMACEUTICALS INC             | 351 | AVALONBAY COMMUNITIES INC     |
| 352 | AVERY DENNISON CORP                       | 353 | AVIS BUDGET GROUP INC                    | 354 | AVISTA CORP                   |
| 355 | AVIVA PLC                                 | 356 | AVNET INC                                | 357 | AVON PRODUCTS INC             |
| 358 | AVX CORP                                  | 359 | AWA BANK LTD/THE                         | 360 | AXA                           |
| 361 | AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS                 | 362 | AXA SA                                   | 363 | AXCAN PHARMA INC              |
| 364 | AXEL SPRINGER AG                          | 365 | AXFOOD AB                                | 366 | AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD     |
| 367 | AXIS COMMUNICATIONS AB                    | 368 | AYALA LAND INC                           | 369 | AZOVSTAL                      |
| 370 | B2W CIA GLOBAL DO VAREJO                  | 371 | BABCOCK & BROWN INFRASTRUCTU             | 372 | BABCOCK & BROWN LTD           |
| 373 | BABCOCK & BROWN POWER                     | 374 | BABCOCK & BROWN WIND PARTNER             | 375 | BABCOCK INTL GROUP PLC        |
| 376 | BACHEM HOLDING AG                         | 377 | BAE SYSTEMS PLC                          | 378 | BAJAJ AUTO LTD                |
| 379 | BAKER HUGHES INC                          | 380 | BAKKAVOR HF                              | 381 | BAKRIELAND DEVELOPMENT TBK PT |

| 項次  | 股票名稱                         | 項次  | 股票名稱                             | 項次  | 股票名稱                               |
|-----|------------------------------|-----|----------------------------------|-----|------------------------------------|
| 382 | BALDOR ELECTRIC              | 383 | BALFOUR BEATTY PLC               | 384 | BALL CORP                          |
| 385 | BALLY TECHNOLOGIES INC       | 386 | BALOISE HOLDING-REG              | 387 | BALTIKA BREWERY                    |
| 388 | BANCA CARIGE SPA             | 389 | BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA     | 390 | BANCA POPOLARE DI MILANO           |
| 391 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 392 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA  | 393 | BANCO BPI SA. - REG SHS            |
| 394 | BANCO BRADESCO SA            | 395 | BANCO PORTUGUES-R COMERCIAL      | 396 | BANCO DE ANDALUCIA S.A.            |
| 397 | BANCO DE CHILE-ADR           | 398 | BANCO DE SABADELL SA             | 399 | BANCO DE VALENCIA SA               |
| 400 | BANCO DO BRASIL SA           | 401 | BANCO ESP CREDITO (BANESTO)      | 402 | BANCO ESPIRITO SANTO-REG           |
| 403 | BANCO GUIPUZCOANO -REGD      | 404 | BANCO ITAU HOLDING FINANCEIRA SA | 405 | BANCO MACRO SA-ADR                 |
| 406 | BANCO PASTOR                 | 407 | BANCO POPOLARE SCARL             | 408 | BANCO POPULAR ESPANOL              |
| 409 | BANCO SANTANDER CHILE SA     | 410 | BANCO SANTANDER SA               | 411 | BANCO SANTANDER SA/BRAZIL          |
| 412 | BANCO SANTANDER SA-SPON ADR  | 413 | BANCO SANTANDER-CHILE-ADR        | 414 | BANCORPSOUTH INC                   |
| 415 | BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD   | 416 | BANGKOK DUSIT MED SERVICE        | 417 | BANK AUSTRIA CREDITANSTALT AG      |
| 418 | BANK BPH SA                  | 419 | BANK CENTRAL ASIA TBK PT         | 420 | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT        |
| 421 | BANK OF AMERICA CORP         | 422 | BANK OF AYUDHYA PCL              | 423 | BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD       |
| 424 | BANK OF EAST ASIA            | 425 | BANK OF EAST ASIA LTD            | 426 | BANK OF GREECE                     |
| 427 | BANK OF HAWAII CORP          | 428 | BANK OF IRELAND                  | 429 | BANK OF IWATE LTD/THE              |
| 430 | BANK OF KYOTO LTD/THE        | 431 | BANK OF MONTREAL                 | 432 | BANK OF MOSCOW                     |
| 433 | BANK OF NAGOYA LTD/THE       | 434 | BANK OF NEW YORK MELLON CORP     | 435 | BANK OF NOVA SCOTIA                |
| 436 | BANK OF QUEENSLAND LTD       | 437 | BANK OF YOKOHAMA LTD/THE         | 438 | BANK PEKAO SA                      |
| 439 | BANK RAKYAT INDONESIA        | 440 | BANK ZACHODNI WBK SA             | 441 | BANKINTER SA                       |
| 442 | BANPU PUBLIC CO LTD          | 443 | BANQUE SAUDI FRANSI              | 444 | BARCLAYS PLC                       |
| 445 | BARCLAYS PLC-SPONS ADR       | 446 | BARD (C.R.) INC                  | 447 | BARE ESSENTUALS INC                |
| 448 | BARITO PACIFIC TBK PT        | 449 | BARNES & NOBLE INC               | 450 | BARNES GROUP INC                   |
| 451 | BARR PHARMACEUTICALS INC     | 452 | BARRATT DEVELOPMENTS PLC         | 453 | BARRICK GOLD CORP                  |
| 454 | BARRY CALLEBAUT AG           | 455 | BARWA REAL ESTATE CO             | 456 | BASF SE                            |
| 457 | BASILEA PHARMACEUTICA        | 458 | BAUER AG                         | 459 | BAXTER INTERNATIONAL INC           |
| 460 | BAYER AG                     | 461 | BAYER SCHERING PHARMA AG         | 462 | BAYERISCHE HYPO-UND VEREINSBANK AG |
| 463 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 464 | BAYTEX ENERGY TRUST-UNITS        | 465 | BAYWA AG                           |
| 466 | BB&T CORP                    | 467 | BBA AVIATION PLC                 | 468 | BBVA BANCO FRANCES SA-ADR          |
| 469 | BCE INC                      | 470 | BE AEROSPACE INC                 | 471 | BEA SYSTEMS INC                    |
| 472 | BEACH PETROLEUM LTD          | 473 | BEAR STEARNS COMPANIES INC       | 474 | BEBE STORES INC                    |
| 475 | BEC WORLD PUBLIC CO LTD      | 476 | BECKMAN COULTER INC              | 477 | BECTON DICKINSON & CO              |
| 478 | BED BATH & BEYOND INC        | 479 | BEFIMMO SCA SICAFI               | 480 | BEIERSDORF AG                      |
| 481 | BEKAERT SA                   | 482 | BELDEN INC                       | 483 | BELGACOM SA                        |
| 484 | BELK INC                     | 485 | BELL ALIANT REGIONAL COMMUNI     | 486 | BELLWAY PLC                        |
| 487 | BELO CORPORATION-A           | 488 | BEMIS COMPANY                    | 489 | BEML LTD                           |
| 490 | BENCHMARK ELECTRONICS INC    | 491 | BENDIGO BANK LIMITED             | 492 | BENESSE CORP                       |
| 493 | BENETEAU SA                  | 494 | BENETTON GROUP SPA               | 495 | BENI STABILI SPA                   |
| 496 | BENUE CEMENT CO PLC          | 497 | BERJAYA SPORTS TOTO BHD          | 498 | BERKELEY HOLDINGS-UNIT GROUP       |
| 499 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 500 | BERRY PETROLEUM CO-CLASS A       | 501 | BERU AG                            |
| 502 | BEST BUY CO INC              | 503 | BFI CANADA INCOME FUND           | 504 | BG GROUP PLC                       |
| 505 | BHARAT ELECTRONICS LTD       | 506 | BHARAT FORGE LTD                 | 507 | BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD       |
| 508 | BHARTI AIRTEL LTD            | 509 | BHP BILLITON LTD                 | 510 | BHP BILLITON PLC                   |
| 511 | BIFFA PLC                    | 512 | BIG C SUPERCENTER PCL            | 513 | BIG LOTS INC                       |
| 514 | BIJOU BRIGITTE AG            | 515 | BILFINGER BERGER AG              | 516 | BILL BARRETT CORP                  |
| 517 | BILLABONG INTERNATIONAL LTD  | 518 | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS        | 519 | BINDURA NICKEL CORP LTD            |
| 520 | BIOCON LTD                   | 521 | BIOGEN IDEC INC                  | 522 | BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC        |
| 523 | BIOMED REALTY TRUST INC      | 524 | BIO-RAD LABORATORIES-CL A        | 525 | BIOTON SA                          |
| 526 | BIOVAIL CORPORATION          | 527 | BJ SERVICES CO                   | 528 | BJ'S WHOLESALE CLUB INC            |
| 529 | BKW FMB ENERGIE AG           | 530 | BLACK & DECKER CORP              | 531 | BLACK HILLS CORP                   |
| 532 | BLACKBAUD INC                | 533 | BLACKROCK INC                    | 534 | BLUE COAT SYSTEMS INC              |
| 535 | BLUESCOPE STEEL LTD          | 536 | BMC SOFTWARE INC                 | 537 | BNP PARIBAS                        |
| 538 | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 539 | BOART LONGYEAR GROUP             | 540 | BOBST GROUP AG                     |
| 541 | BOEHLER-UDDEHOLM AG          | 542 | BOEING CO                        | 543 | BOIS D' ARC ENERGY INC             |
| 544 | BOK FINANCIAL CORPORATION    | 545 | BOLIDEN AB                       | 546 | BOLSAS Y MERCADOS ESPANOLES        |
| 547 | BOMBARDIER INC               | 548 | BONAVISTA ENERGY TRUST           | 549 | BONGRAIN SA                        |
| 550 | BONHEUR A/S                  | 551 | BORAL LIMITED                    | 552 | BORGWARNER INC                     |
| 553 | BOSCH CORP                   | 554 | BOSCH LTD                        | 555 | BOSKALIS WESTMINSTER-CVA           |
| 556 | BOSTON PROPERTIES INC        | 557 | BOSTON SCIENTIFIC CORP           | 558 | BOUBYAN PETROCHEMICALS CO          |
| 559 | BOURBON SA                   | 560 | BOUSTEAD HOLDINGS BHD            | 561 | BOUYGUES                           |
| 562 | BOVIS HOMES GROUP PLC        | 563 | BOYD GAMING CORP                 | 564 | BP PLC                             |
| 565 | BPO PROPERTIES LTD           | 566 | BR MALLS PARTICIPACOES SA        | 567 | BRADESCO SA                        |
| 568 | BRADFORD & BINGLEY PLC       | 569 | BRADY CORPORATION - CL A         | 570 | BRAMBLES LTD                       |
| 571 | BRANDYWINE REALTY TRUST      | 572 | BRASKEM SA                       | 573 | BRASMOTOR SA                       |
| 574 | BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE  | 575 | BRE PROPERTIES INC               | 576 | BREDERODE (SA FINANCIERE)          |

| 項次  | 股票名稱                                     | 項次  | 股票名稱                         | 項次  | 股票名稱                              |
|-----|--|-----|------------------------------|-----|-----------------------------------|
| 577 | BREITBURN ENERGY PARTNERS LP             | 578 | BRICKWORKS LTD               | 579 | BRIDGESTONE CORP                  |
| 580 | BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUT             | 581 | BRINKER INTERNATIONAL INC    | 582 | BRINK'S CO/THE                    |
| 583 | BRISA                                    | 584 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 585 | BRISTOW GROUP INC                 |
| 586 | BRIT INSURANCE HOLDINGS PLC              | 587 | BRITISH AIRWAYS PLC          | 588 | BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD      |
| 589 | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC             | 590 | BRITISH ENERGY GROUP PLC     | 591 | BRITISH LAND CO PLC               |
| 592 | BRITISH SKY BROADCASTING GRO             | 593 | BROADCOM CORP-CL A           | 594 | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO      |
| 595 | BROCADE COMMUNICATIONS SYS               | 596 | BROOKDALE SENIOR LIVING INC  | 597 | BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A      |
| 598 | BROOKFIELD PROPERTIES CORP               | 599 | BROTHER INDUSTRIES LTD       | 600 | BROWN & BROWN INC                 |
| 601 | BROWN-FORMAN CORP-CLASS A                | 602 | BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    | 603 | BRUKER BIOSCIENCES CORP           |
| 604 | BRUNSWICK CORP                           | 605 | BT GROUP PLC                 | 606 | BUCHER INDUSTRIES AG              |
| 607 | BUCYRUS INTERNATIONAL INC-A              | 608 | BULGARI SPA                  | 609 | BUMI RESOURCES TBK PT             |
| 610 | BUMIPUTRA-COMMERCE HLDGS BHD             | 611 | BUNGE LTD                    | 612 | BUNZL PLC                         |
| 613 | BURBERRY GROUP PLC                       | 614 | BURGER KING HOLDINGS INC     | 615 | BURLINGTON NORTHERN SANTA FE      |
| 616 | BURREN ENERGY PLC                        | 617 | BURSA MALAYSIA BHD           | 618 | BUSINESS OBJECTS                  |
| 619 | BUSINESS OBJECTS SA-SP ADR               | 620 | BUZZI UNICEM SPA             | 621 | BW GAS ASA                        |
| 622 | C&C GROUP PLC                            | 623 | C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 624 | CA IMMOBILIEN ANLAGEN AG          |
| 625 | CA INC                                   | 626 | CABCHARGE AUSTRALIA LTD      | 627 | CABLE & WIRELESS PLC              |
| 628 | CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A             | 629 | CABOT CORP                   | 630 | CABOT OIL & GAS CORP              |
| 631 | CACI INTERNATIONAL INC -CL A             | 632 | CADBURY SCHWEPPES PLC        | 633 | CADENCE DESIGN SYS INC            |
| 634 | CAE INC                                  | 635 | CAIRN ENERGY PLC             | 636 | CALAMOS ASSET MANAGEMENT-A        |
| 637 | CALLAWAY GOLF COMPANY                    | 638 | ALLOWAY REAL ESTATE INVESTM  | 639 | CALSONIC KANSEI CORP              |
| 640 | CALTEX AUSTRALIA LIMITED                 | 641 | CALUMET SPECIALTY PRODUCTS   | 642 | CAMAIEU                           |
| 643 | CAMDEN PROPERTY TRUST                    | 644 | CAMECO CORP                  | 645 | CAMERON INTERNATIONAL CORP        |
| 646 | CAMPBELL SOUP CO                         | 647 | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 648 | CAN REAL ESTATE INVEST TRUST      |
| 649 | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE/CANAD | 650 | CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 651 | CANADIAN NATURAL RESOURCES        |
| 652 | CANADIAN OIL SANDS TRUST                 | 653 | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 654 | CANADIAN TIRE CORP -CL A          |
| 655 | CANADIAN UTILITIES LTD A                 | 656 | CANADIAN WESTERN BANK        | 657 | CANFOR CORPORATION                |
| 658 | CANON INC                                | 659 | CANON MARKETING JAPAN INC    | 660 | CAP GEMINI SA                     |
| 661 | CAP SA                                   | 662 | CAPCOM CO LTD                | 663 | CAPELLA EDUCATION CO              |
| 664 | CAPITA GROUP PLC                         | 665 | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 666 | CAPITALAND LTD                    |
| 667 | CAPITALSOURCE INC                        | 668 | CAPITAMALL TRUST             | 669 | CAPITOL FEDERAL FINANCIAL         |
| 670 | CARDINAL HEALTH INC                      | 671 | CAREER EDUCATION CORP        | 672 | CARGOTEC CORP-B SHARE             |
| 673 | CARILLION PLC                            | 674 | CARLISLE COS INC             | 675 | CARLSBERG AS-B                    |
| 676 | CARMAX INC                               | 677 | CARNIVAL CORP                | 678 | CARNIVAL PLC                      |
| 679 | CARPENTER TECHNOLOGY                     | 680 | CARPHONE WAREHOUSE GROUP     | 681 | CARREFOUR SA                      |
| 682 | CARREFOURSA CARREFOUR SABANCI TICARET ME | 683 | CARRIZO OIL & GAS INC        | 684 | CARSO GLOBAL TELECOM SAB DE CV    |
| 685 | CARSO INFRAESTRUCTURA Y CONSTRUCCION SAB | 686 | CARTER'S INC                 | 687 | CASEY'S GENERAL STORES INC        |
| 688 | CASINO GUICHARD PERRACHON                | 689 | CASIO COMPUTER CO LTD        | 690 | CASTELLUM AB                      |
| 691 | CATERPILLAR INC                          | 692 | CATHAY GENERAL BANCORP       | 693 | CATHAY PACIFIC AIRWAYS            |
| 694 | CATHAY PACIFIC AIRWAYS LTD               | 695 | CATTLES PLC                  | 696 | CATTOLICA ASSICURAZIONI SCRL      |
| 697 | CB RICHARD ELLIS GROUP INC-A             | 698 | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES  | 699 | CBS CORP-CLASS A                  |
| 700 | CCL INDUSTRIES INC - CL B                | 701 | CELANESE CORP-SERIES A       | 702 | CELESIO AG                        |
| 703 | CELESTICA INC                            | 704 | CELGENE CORP                 | 705 | CELLCOM ISRAEL LTD                |
| 706 | CEMENTIR HOLDING SPA                     | 707 | CEMENTOS ARGOS SA            | 708 | CEMENTOS MOLINS SA                |
| 709 | CEMENTOS PORTLANDVALDERRIVAS             | 710 | CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER | 711 | CENTERPOINT ENERGY INC            |
| 712 | CENTERRA GOLD INC                        | 713 | CENTEX CORP                  | 714 | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA |
| 715 | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B             | 716 | CENTRAL EURO DISTRIBUTION CP | 717 | CENTRAL EUROPEAN MEDIA ENT-A      |
| 718 | CENTRAL JAPAN RAILWAY CO                 | 719 | CENTRAL PATTANA PUB CO LTD   | 720 | CENTRICA PLC                      |
| 721 | CENTROS COMERCIALES SUDAMERICANOSA       | 722 | CENTURY ALUMINUM COMPANY     | 723 | CENTURYTEL INC                    |
| 724 | CEPHALON INC                             | 725 | CEPHEID INC                  | 726 | CERADYNE INC                      |
| 727 | CERNER CORP                              | 728 | CERSANIT KRASNISTAW SA       | 729 | CEZ                               |
| 730 | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC               | 731 | CFS RETAIL PROPERTY TRUST    | 732 | CGI GROUP INC - CL A              |
| 733 | CH ROBINSON WORLDWIDE INC                | 734 | CHALLENGER FINANCIAL SERVICE | 735 | CHARLES RIVER LABORATORIES        |
| 736 | CHARLES SCHWAB CORP/THE                  | 737 | CHARTER PLC                  | 738 | CHARTERED SEMICONDUCTOR-ADR       |
| 739 | CHATTEM INC                              | 740 | CHC HELICOPTER CORP-CL A     | 741 | CHECK POINT SOFTWARE TECH         |
| 742 | CHEESECAKE FACTORY (THE)                 | 743 | CHEIL COMMUNICATIONS INC     | 744 | CHEIL INDUSTRIES INC              |
| 745 | CHELYABINSK PIPE WORKS                   | 746 | CHEMED CORP                  | 747 | CHEMRING GROUP PLC                |
| 748 | CHEMTURA CORP                            | 749 | CHESAPEAKE ENERGY CORP       | 750 | CHEUNG KONG HOLDINGS LTD          |
| 751 | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE               | 752 | CHEVRON CORP                 | 753 | CHIBA BANK LTD/THE                |
| 754 | CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR             | 755 | CHICO'S FAS INC              | 756 | CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A       |
| 757 | CHIYODA CORP                             | 758 | CHOICE HOTELS INTL INC       | 759 | CHOICEPOINT INC                   |
| 760 | CHRISTIAN DIOR                           | 761 | CHUBB CORP                   | 762 | CHUBU ELECTRIC POWER CO INC       |
| 763 | CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD             | 764 | CHUGOKU BANK LTD/THE         | 765 | CHUGOKU ELECTRIC POWER CO         |

| 項次  | 股票名稱                                    | 項次  | 股票名稱                                     | 項次  | 股票名稱                                |
|-----|---|-----|--|-----|-------------------------------------|
| 766 | CHUO MITSUI TRUST HOLDINGS              | 767 | CHURCH & DWIGHT CO INC                   | 768 | CI FINANCIAL INCOME FUND            |
| 769 | CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR              | 770 | CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS              | 771 | CIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS       |
| 772 | CIA DE DISTRIBUCION INTEGRAL LOGISTA SA | 773 | CIA DE GAS DE SAO PAULO                  | 774 | CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA        |
| 775 | CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR            | 776 | CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SA | 777 | CIA DISTRIB INTEGRAL LOGISTA        |
| 778 | CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS          | 779 | CIA ENERGETICA DE SAO PAULO              | 780 | CIA ESPANOLA DE PETROLEOS SA        |
| 781 | CIA MINERA MILPO SAA                    | 782 | CIA PARANAENSE DE ENERGIA                | 783 | CIA PARANAENSE ENER-SP ADR P        |
| 784 | CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR            | 785 | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA              | 786 | CIA SIDERURGICA NAACL-SP ADR        |
| 787 | CIA SUDAMERICANA DE VAPORES SA          | 788 | CIA TELECOM CHILE-SPONS ADR              | 789 | CIA VALE DO RIO DOCE                |
| 790 | CIA VALE DO RIO DOCE-ADR                | 791 | CIBA SPECIALTY CHEMICALS-REG             | 792 | CIE DE SAINT-GOBAIN                 |
| 793 | CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A            | 794 | CIE GEN GEOPHYSIQUE-SP ADR               | 795 | CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE         |
| 796 | CIECH SA                                | 797 | CIENA CORP                               | 798 | CIGNA CORP                          |
| 799 | CIMAREX ENERGY CO                       | 800 | CIMENTS DU MAROC                         | 801 | CIMENTS FRANCAIS SA                 |
| 802 | CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL             | 803 | CINCINNATI FINANCIAL CORP                | 804 | CINEMARK HOLDINGS INC               |
| 805 | CINTAS CORP                             | 806 | CINTRA CONCESIONES DE INFRAE             | 807 | CIRCLE K SUNKUS CO LTD              |
| 808 | CISCO SYSTEMS INC                       | 809 | CIT GROUP INC                            | 810 | CITIC PACIFIC LIMITED               |
| 811 | CITIGROUP INC                           | 812 | CITIZEN HOLDINGS CO LTD                  | 813 | CITIZENS COMMUNICATIONS CO          |
| 814 | CITRIX SYSTEMS INC                      | 815 | CITY DEVELOPMENTS LTD                    | 816 | CITY NATIONAL CORP                  |
| 817 | CITYCON OYJ                             | 818 | CJ CHEILJEDANG CORP                      | 819 | CJ CORP                             |
| 820 | CLARCOR INC                             | 821 | CLARIANT AG-REG                          | 822 | CLAS OHLSON AB                      |
| 823 | CLEAN HARBORS INC                       | 824 | CLEAR CHANNEL COMMUNICATIONS             | 825 | CLEAR CHANNEL OUTDOOR-CL A          |
| 826 | CLEARWIRE CORP-CLASS A                  | 827 | CLECO CORPORATION                        | 828 | CLEVELAND-CLIFFS INC                |
| 829 | CLIPPER WINDPOWER PLC                   | 830 | CLOROX COMPANY                           | 831 | CLOSE BROTHERS GROUP PLC            |
| 832 | CLP HOLDINGS LTD                        | 833 | CME GROUP INC                            | 834 | CML HEALTHCARE INCOME FUND          |
| 835 | CMS ENERGY CORP                         | 836 | CNA FINANCIAL CORP                       | 837 | CNET NETWORKS INC                   |
| 838 | CNH GLOBAL N.V.                         | 839 | CNP ASSURANCES                           | 840 | CNP -CIE NATL A PORTEFEUILLE        |
| 841 | CNX GAS CORP                            | 842 | COACH INC                                | 843 | COAL & ALLIED INDUSTRIES LTD        |
| 844 | COAL MINE CHERVONOARMIYSKA ZAHIDNA 1    | 845 | COBHAM PLC                               | 846 | COCA COLA HELLENIC BOTTLING CO SA   |
| 847 | COCA COLA HELLENIC BTLNG-ADR            | 848 | COCA-COLA AMATIL LIMITED                 | 849 | COCA-COLA CO/THE                    |
| 850 | COCA-COLA ENTERPRISES                   | 851 | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV                | 852 | COCA-COLA FEMSA SAB-SP ADR          |
| 853 | COCA-COLA HELLENIC BOTTLING             | 854 | COCA-COLA WEST HOLDINGS CO L             | 855 | COCHLEAR LIMITED                    |
| 856 | CODERE SA                               | 857 | COEUR D'ALENE MINES - CDI                | 858 | COFINIMMO                           |
| 859 | COGECO CABLE INC                        | 860 | COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A               | 861 | COGNOS INC                          |
| 862 | COHEN & STEERS INC                      | 863 | COLAS SA                                 | 864 | COLGATE-PALMOLIVE CO                |
| 865 | COLLECTIVE BRANDS INC                   | 866 | COLONIAL BANCGROUP INC                   | 867 | COLONIAL PROPERTIES TRUST           |
| 868 | COLOPLAST-B                             | 869 | COLRUYT SA                               | 870 | COLUMBIA SPORTSWEAR CO              |
| 871 | COMCAST CORP-CL A                       | 872 | COMDIRECT BANK AG                        | 873 | COMERICA INC                        |
| 874 | COMFORTDELGRO CORP LTD                  | 875 | COMMERCE BANCORP INC/NJ                  | 876 | COMMERCE BANCSHARES INC             |
| 877 | COMMERCE GROUP INC                      | 878 | COMMERCIAL METALS CO                     | 879 | COMMERCIAL REAL ESTATE CO           |
| 880 | COMMERZBANK AG                          | 881 | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL             | 882 | COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE        |
| 883 | COMMSCOPE INC                           | 884 | COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC             | 885 | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN           |
| 886 | COMPAGNIE D'ENTREPRISES CFE             | 887 | COMPAGNIE DU CAMBODGE                    | 888 | COMPAGNIE MARITIME BELGE SA         |
| 889 | COMPANHIA DE BEBIDAS-ADR                | 890 | COMPASS GROUP PLC                        | 891 | COMPASS MINERALS INTERNATION        |
| 892 | COMPLETE PRODUCTION SERVICES            | 893 | COMPTON PETROLEUM CORP                   | 894 | COMPUTER SCIENCES CORP              |
| 895 | COMPUTERSHARE LIMITED                   | 896 | COMPUWARE CORP                           | 897 | COMSTOCK RESOURCES INC              |
| 898 | COMSYS HOLDINGS CORP                    | 899 | COMTECH TELECOMMUNICATIONS               | 900 | CONAGRA FOODS INC                   |
| 901 | CONCHO RESOURCES INC                    | 902 | CONCUR TECHNOLOGIES INC                  | 903 | CONNECTEAST GROUP                   |
| 904 | CONOCOPHILLIPS                          | 905 | CONSECO INC                              | 906 | CONSOL ENERGY INC                   |
| 907 | CONSOLIDATED EDISON INC                 | 908 | CONSOLIDATED MEDIA HOLDINGS              | 909 | CONSORCIO ARA SAB DE CV             |
| 910 | CONSTANTIA PACKAGING AG                 | 911 | CONSTELLATION BRANDS INC-A               | 912 | CONSTELLATION ENERGY GROUP          |
| 913 | CONSTRUC Y AUX DE FERROCARR             | 914 | CONTINENTAL AG                           | 915 | CONTINENTAL AIRLINES-CLASS B        |
| 916 | CONTINENTAL RESOURCES INC/OK            | 917 | CONVERGYS CORP                           | 918 | CON-WAY INC                         |
| 919 | CONWERT IMMOBILIEN INVEST SE            | 920 | COOKSON GROUP PLC                        | 921 | COOPER COS INC/THE                  |
| 922 | COOPER INDUSTRIES LTD-CL A              | 923 | COOPER TIRE & RUBBER                     | 924 | COPA HOLDINGS SA-CLASS A            |
| 925 | COPANO ENERGY LLC-UNITS                 | 926 | COPART INC                               | 927 | CORE LABORATORIES N.V.              |
| 928 | CORIO NV                                | 929 | CORN PRODUCTS INTL INC                   | 930 | CORNING INC                         |
| 931 | CORP FINANCIERA ALBA                    | 932 | CORP GEO SAB DE CV                       | 933 | CORP MOCTEZUMA SAB DE CV            |
| 934 | CORPBANCA SA-ADR                        | 935 | CORPORACION FINANCIERA ALBA              | 936 | CORPORATE EXECUTIVE BOARD CO        |
| 937 | CORPORATE EXPRESS                       | 938 | CORPORATE OFFICE PROPERTIES              | 939 | CORRECTIONS CORP OF AMERICA         |
| 940 | CORUS ENTERTAINMENT INC-B SH            | 941 | COSAN LTD-CLASS A SHARES                 | 942 | COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO       |
| 943 | COSCO CORP SINGAPORE LTD                | 944 | COSMO OIL COMPANY LTD                    | 945 | COSMOTE MOBILE TELECOMMUNICATIONSSA |
| 946 | COSTCO WHOLESALE CORP                   | 947 | COUNTRYWIDE FINANCIAL CORP               | 948 | COUSINS PROPERTIES INC              |

| 項次   | 股票名稱                                  | 項次   | 股票名稱                               | 項次   | 股票名稱                                     |
|------|---------------------------------------|------|------------------------------------|------|--|
| 949  | COVANCE INC                           | 950  | COVANTA HOLDING CORP               | 951  | COVENTRY HEALTH CARE INC                 |
| 952  | COVIDIEN LTD                          | 953  | COX RADIO INC-CL A                 | 954  | CP ALL PCL                               |
| 955  | CPFL ENERGIA SA                       | 956  | CPFL ENERGIA SA-ADR                | 957  | CR BARD INC                              |
| 958  | CRANE CO                              | 959  | CREDICORP LTD                      | 960  | CREDIT AGRICOLE SA                       |
| 961  | CREDIT INDUSTRIEL COMMERCIAL ET       | 962  | CREDIT SAISON CO LTD               | 963  | CREDIT SUISSE GROUP-REG                  |
| 964  | CREDIT SUISSE GROUP-SPON ADR          | 965  | CREE INC                           | 966  | CRESCENT POINT ENERGY TRUST              |
| 967  | CRH PLC                               | 968  | CRH PLC-SPONSORED ADR              | 969  | CRITERIA CAIXACORP SA                    |
| 970  | CROCS INC                             | 971  | CRODA INTERNATIONAL                | 972  | CROMPTON GREAVES LTD                     |
| 973  | CROSSTEX ENERGY INC                   | 974  | CROSSTEX ENERGY LP                 | 975  | CROWN CASTLE INTL CORP                   |
| 976  | CROWN HOLDINGS INC                    | 977  | CROWN LTD                          | 978  | CSK HOLDINGS CORP                        |
| 979  | CSL LIMITED                           | 980  | CSM                                | 981  | CSR LIMITED                              |
| 982  | CSR PLC                               | 983  | CSX CORP                           | 984  | CTC MEDIA INC                            |
| 985  | CULLEN/FROST BANKERS INC              | 986  | CUMMINS INC                        | 987  | CUMMINS INDIA LTD                        |
| 988  | CURTISS-WRIGHT CORP                   | 989  | CVR ENERGY INC                     | 990  | CVS CAREMARK CORP                        |
| 991  | CYPRESS SEMICONDUCTOR CORP            | 992  | CYRELA BRAZIL REALTY SA            | 993  | CYTEC INDUSTRIES INC                     |
| 994  | D/S NORDEN                            | 995  | D/S TORM A/S                       | 996  | DAEGU BANK                               |
| 997  | DAEJAN HOLDINGS                       | 998  | DAELIM INDUSTRIAL CO LTD           | 999  | DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD |
| 1000 | DAEWOO INTERNATIONAL CORP             | 1001 | DAEWOO SECURITIES CO LTD           | 1002 | DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE             |
| 1003 | DAI NIPPON PRINTING CO LTD            | 1004 | DAIBIRU CORP                       | 1005 | DAICEL CHEMICAL INDUSTRIES               |
| 1006 | DAIDO STEEL CO LTD                    | 1007 | DAIFUKU CO LTD                     | 1008 | DAIHATSU MOTOR CO LTD                    |
| 1009 | DAIICHI CHUO KISEN KAISHA             | 1010 | DAIICHI SANKYO CO LTD              | 1011 | DAIKIN INDUSTRIES LTD                    |
| 1012 | DAILY MAIL&GENERAL TST-A NV           | 1013 | DAIMLER AG                         | 1014 | DAINIPPON INK AND CHEMICALS              |
| 1015 | DAINIPPON SCREEN MFG CO LTD           | 1016 | DAINIPPON SUMITOMO PHARMA CO       | 1017 | DAIRY CREST GROUP PLC                    |
| 1018 | DAIRY FARM INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 1019 | DAISEKI CO LTD                     | 1020 | DAISHI BANK LTD/THE                      |
| 1021 | DAISHIN SECURITIES CO LTD             | 1022 | DAITO TRUST CONSTRUCT CO LTD       | 1023 | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD              |
| 1024 | DAIWA SECURITIES GROUP INC            | 1025 | DAMPSKIBSSELSKABET TORM-ADR        | 1026 | DANAHER CORP                             |
| 1027 | DANAOS CORP                           | 1028 | DANGOTE SUGAR REFINERY PLC         | 1029 | DANISCO A/S                              |
| 1030 | DANSKE BANK A/S                       | 1031 | DARDEN RESTAURANTS INC             | 1032 | DASSAULT AVIATION SA                     |
| 1033 | DASSAULT SYSTEMES SA                  | 1034 | DATA DOMAIN INC                    | 1035 | DAVID JONES LIMITED                      |
| 1036 | DAVIS SERVICE GROUP PLC               | 1037 | DAVITA INC                         | 1038 | DB RREEF TRUST                           |
| 1039 | DBS GROUP HOLDINGS LTD                | 1040 | DC CHEMICAL CO LTD                 | 1041 | DCC PLC                                  |
| 1042 | DCT INDUSTRIAL TRUST INC              | 1043 | DE LA RUE PLC                      | 1044 | DEAN FOODS CO                            |
| 1045 | DEBENHAMS PLC                         | 1046 | DECKERS OUTDOOR CORP               | 1047 | DEERE & CO                               |
| 1048 | DEL MONTE FOODS CO                    | 1049 | DELEK GROUP LTD                    | 1050 | DELHAIZE GROUP                           |
| 1051 | DELL INC                              | 1052 | DELPHI FINANCIAL GROUP-CL A        | 1053 | DELTA AIR LINES INC                      |
| 1054 | DELTA PETROLEUM CORP                  | 1055 | DELUXE CORP                        | 1056 | DENA CO LTD                              |
| 1057 | DENBURY RESOURCES INC                 | 1058 | DENISON MINES CORP                 | 1059 | DENKI KAGAKU KOGYO K K                   |
| 1060 | DENSO CORP                            | 1061 | DENTSPLY INTERNATIONAL INC         | 1062 | DENTSU INC                               |
| 1063 | DERWENT LONDON PLC                    | 1064 | DESARROLLADORA HOMEX SAB DE CV     | 1065 | DESARROLLADORA HOMEX-ADR                 |
| 1066 | DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED           | 1067 | DEUTSCHE BOERSE AG                 | 1068 | DEUTSCHE EUROSHOP AG                     |
| 1069 | DEUTSCHE LUFTHANSA-REG                | 1070 | DEUTSCHE POST AG-REG               | 1071 | DEUTSCHE POSTBANK AG                     |
| 1072 | DEUTSCHE TELEKOM AG-REG               | 1073 | DEUTSCHE TELEKOM AG-SPON ADR       | 1074 | DEUTZ AG                                 |
| 1075 | DEVELOPERS DIVERSIFIED RLTY           | 1076 | DEVON ENERGY CORPORATION           | 1077 | DEVRY INC                                |
| 1078 | DEXIA SA                              | 1079 | DIAGEO PLC                         | 1080 | DIAGEO PLC-SPONSORED ADR                 |
| 1081 | DIAMOND OFFSHORE DRILLING             | 1082 | DIAMONDROCK HOSPITALITY CO         | 1083 | DIANA SHIPPING INC                       |
| 1084 | DICK'S SPORTING GOODS INC             | 1085 | DIEBOLD INC                        | 1086 | D'IETTEREN SA                            |
| 1087 | DIGI.COM BHD                          | 1088 | DIGITAL REALTY TRUST INC           | 1089 | DIGITAL RIVER INC                        |
| 1090 | DILLARDS INC-CL A                     | 1091 | DIMENSION DATA HOLDINGS PLC        | 1092 | DIONEX CORP                              |
| 1093 | DIRECTV GROUP INC/THE                 | 1094 | DIS DEUTSCHER INDUSTRIE SERVICE AG | 1095 | DISCO CORP                               |
| 1096 | DISCOUNT INVESTMENT CORP              | 1097 | DISCOVER FINANCIAL SERVICES        | 1098 | DISCOVERY HOLDING CO-A                   |
| 1099 | DISH NETWORK CORP-A                   | 1100 | DISTRIBUCION Y SERVICIO D&S SA     | 1101 | DISTRIBUCION Y SERVICIO-ADR              |
| 1102 | DISTRIGAZ                             | 1103 | DLF LTD                            | 1104 | DNB NOR ASA                              |
| 1105 | DOCTOR REDDY'S LAB-ADR                | 1106 | DOLBY LABORATORIES INC-CL A        | 1107 | DOLLAR TREE STORES INC                   |
| 1108 | DOLPHIN CAPITAL INVESTORS LTD         | 1109 | DOMINION RESOURCES INC/VA          | 1110 | DOMTAR CORP                              |
| 1111 | DON QUIJOTE CO LTD                    | 1112 | DONALDSON CO INC                   | 1113 | DONG-A PHARMACEUTICAL CO LTD             |
| 1114 | DONGBU INSURANCE CO LTD               | 1115 | DONGKUK STEEL MILL CO LTD          | 1116 | DOOSAN CONSTRUCTION & ENGINE             |
| 1117 | DOOSAN CORP                           | 1118 | DOOSAN HEAVY INDUSTRIES            | 1119 | DOOSAN INFRACORE CO LTD                  |
| 1120 | DORAL FINANCIAL CORP                  | 1121 | DOUGLAS EMMETT INC                 | 1122 | DOUGLAS HOLDING AG                       |
| 1123 | DOUJA PROMOTION GROUPE ADDOHA SA      | 1124 | DOVER CORP                         | 1125 | DOW CHEMICAL                             |
| 1126 | DOWA HOLDINGS CO LTD                  | 1127 | DOWNER EDI LIMITED                 | 1128 | DPL INC                                  |
| 1129 | DR HORTON INC                         | 1130 | DRAKA HOLDING                      | 1131 | DRAX GROUP PLC                           |
| 1132 | DREAMWORKS ANIMATION SKG-A            | 1133 | DRESSER-RAND GROUP INC             | 1134 | DRIL-QUIP INC                            |
| 1135 | DRS TECHNOLOGIES INC                  | 1136 | DRYSHIPS INC                       | 1137 | DSG INTERNATIONAL PLC                    |
| 1138 | DST SYSTEMS INC                       | 1139 | DSV A/S                            | 1140 | DTE ENERGY COMPANY                       |

| 項次   | 股票名稱                                  | 項次   | 股票名稱                                  | 項次   | 股票名稱                                    |
|------|---------------------------------------|------|---------------------------------------|------|---|
| 1141 | DU PONT (E.I.) DE NEMOURS             | 1142 | DUBAI FINANCIAL MARKET                | 1143 | DUBAI INVESTMENTS                       |
| 1144 | DUBAI ISLAMIC BANK                    | 1145 | DUET GROUP                            | 1146 | DUFRY GROUP                             |
| 1147 | DUFRY SOUTH AMERICA LTD               | 1148 | DUKE ENERGY CORP                      | 1149 | DUKE REALTY CORP                        |
| 1150 | DUN & BRADSTREET CORP                 | 1151 | DUNDEE CORP -CL A                     | 1152 | DUNDEEWALTH INC                         |
| 1153 | DURATEX SA                            | 1154 | DURO FELGUERA SA                      | 1155 | DUSKIN CO LTD                           |
| 1156 | DUVERNAY OIL CORP                     | 1157 | DYCKERHOFF AG                         | 1158 | DYNEGY INC-CL A                         |
| 1159 | DYNO NOBEL LTD                        | 1160 | E*TRADE FINANCIAL CORP                | 1161 | E. ON AG                                |
| 1162 | EADS                                  | 1163 | EAGLE BULK SHIPPING INC               | 1164 | EAGLE MATERIALS INC                     |
| 1165 | EAGLE ROCK ENERGY PARTNERS            | 1166 | EAST JAPAN RAILWAY CO                 | 1167 | EAST WEST BANCORP INC                   |
| 1168 | EASTERN CEMENT                        | 1169 | EASTERN PLATINUM LTD                  | 1170 | EASTGROUP PROPERTIES INC                |
| 1171 | EASTMAN CHEMICAL COMPANY              | 1172 | EASTMAN KODAK CO                      | 1173 | EASYJET PLC                             |
| 1174 | EATON CORP                            | 1175 | EATON VANCE CORP                      | 1176 | EBARA CORP                              |
| 1177 | EBAY INC                              | 1178 | EBRO PULEVA SA                        | 1179 | ECHO INVESTMENT SA                      |
| 1180 | ECHOSTAR CORP-A                       | 1181 | ECLIPSYS CORP                         | 1182 | ECOLAB INC                              |
| 1183 | ECONET WIRELESS HOLDINGS              | 1184 | EDF ENERGIES NOUVELLES SA             | 1185 | EDION CORP                              |
| 1186 | EDISON INTERNATIONAL                  | 1187 | EDISON SPA                            | 1188 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP               |
| 1189 | EFG EUROBANK ERGASIAS                 | 1190 | EGYPT KUWAIT HOLDING CO               | 1191 | EGYPTIAN FINANCIAL GROUP-HERMES HOLDING |
| 1192 | EI DU PONT DE NEMOURS                 | 1193 | EIENDOMSSPAR AS                       | 1194 | EIFFAGE                                 |
| 1195 | EISAI CO LTD                          | 1196 | EL PASO CORP                          | 1197 | EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV        |
| 1198 | EL SEWEDY CABLES HOLDING CO           | 1199 | ELAN CORP PLC                         | 1200 | ELAN CORP PLC -SPONS ADR                |
| 1201 | ELBIT IMAGING LTD                     | 1202 | ELBIT SYSTEMS LTD                     | 1203 | ELDORADO GOLD CORPORATION               |
| 1204 | ELECTRIC POWER DEVELOPMENT C          | 1205 | ELECTRICITE DE FRANCE                 | 1206 | ELECTRICITY GENERATING PCL              |
| 1207 | ELECTRIFICACIONES DEL NORTE           | 1208 | ELECTROCOMPONENTS PLC                 | 1209 | ELECTROLUX AB-SER B                     |
| 1210 | ELECTRONIC ARTS INC                   | 1211 | ELECTRONIC DATA SYSTEMS CORP          | 1212 | ELEKTRO ELETRICIDADE E SERVICOS SA      |
| 1213 | ELI LILLY & CO                        | 1214 | ELISA OYJ                             | 1215 | ELPIDA MEMORY INC                       |
| 1216 | ELRINGKLINGER AG                      | 1217 | EMAAR ECONOMIC CITY                   | 1218 | EMAAR PROPERTIES PJSC                   |
| 1219 | EMAP PLC                              | 1220 | EMBARQ CORP                           | 1221 | EMBOTELLADORA ANDINA-ADR A              |
| 1222 | EMC CORP/MASS                         | 1223 | EMCOR GROUP INC                       | 1224 | EMERA INC                               |
| 1225 | EMERGENCY MEDICAL SERVICES-A          | 1226 | EMERSON ELECTRIC CO                   | 1227 | EMIRATES TELECOM CORP                   |
| 1228 | EMPIRE CO LTD 'A'                     | 1229 | EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA SA  | 1230 | EMPRESA NAC ELEC-CHIL-SP ADR            |
| 1231 | EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIC          | 1232 | EMPRESAS CMPC SA                      | 1233 | EMPRESAS ICA S.A. -SPONS ADR            |
| 1234 | EMPRESAS ICA SAB DE CV                | 1235 | EMS-CHEMIE HOLDING AG                 | 1236 | EMULEX CORP                             |
| 1237 | ENAGAS                                | 1238 | ENBRIDGE INC                          | 1239 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG      |
| 1240 | ENCANA CORP                           | 1241 | ENCORE ACQUISITION CO                 | 1242 | ENDESA SA                               |
| 1243 | ENDO PHARMACEUT HLDGS INC             | 1244 | ENDURANCE SPECIALTY HOLDINGS          | 1245 | ENEL SPA                                |
| 1246 | ENERGEN CORP                          | 1247 | ENERGIAS DE PORTUGAL SA               | 1248 | ENERGIZER HOLDINGS INC                  |
| 1249 | ENERGY CONVERSION DEVICES             | 1250 | ENERGY EAST CORPORATION               | 1251 | ENERGY RESOURCES OF AUST                |
| 1252 | ENERGY SAVINGS INCOME FUND            | 1253 | ENERGYSOLUTIONS INC                   | 1254 | ENERPLUS RESOURCES FUND                 |
| 1255 | ENERSYS S.A. -SPONS ADR               | 1256 | ENERSYS SA                            | 1257 | ENERSYS                                 |
| 1258 | ENI SPA                               | 1259 | ENI SPA-SPONSORED ADR                 | 1260 | ENIRO AB                                |
| 1261 | ENKA INSAAT VE SANAYI AS              | 1262 | ENSCO INTERNATIONAL INC               | 1263 | ENSIGN ENERGY SERVICES INC              |
| 1264 | ENSTAR GROUP LTD                      | 1265 | ENTERGY CORP                          | 1266 | ENTERPRISE INNS PLC                     |
| 1267 | ENTERTAINMENT PROPERTIES TR           | 1268 | EOG RESOURCES INC                     | 1269 | EON CAPITAL BHD                         |
| 1270 | EPCOR POWER LP                        | 1271 | EQUIFAX INC                           | 1272 | EQUINIX INC                             |
| 1273 | EQUINOX MINERALS LTD                  | 1274 | EQUITABLE RESOURCES INC               | 1275 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES             |
| 1276 | EQUITY ONE INC                        | 1277 | EQUITY RESIDENTIAL                    | 1278 | ERAMET                                  |
| 1279 | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS | 1280 | ERGO VERSICHERUNGSGRUPPE AG           | 1281 | ERICSSON (LM) TEL-SP ADR                |
| 1282 | ERICSSON LM-B SHS                     | 1283 | ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A           | 1284 | ERSTE BANK DER OESTER SPARK             |
| 1285 | ESCO TECHNOLOGIES INC                 | 1286 | ESPRIT HOLDINGS LTD                   | 1287 | ESSEX PROPERTY TRUST INC                |
| 1288 | ESSILOR INTERNATIONAL                 | 1289 | ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A           | 1290 | ESTERLINE TECHNOLOGIES CORP             |
| 1291 | ETIHAD ETISALAT CO                    | 1292 | EULER HERMES SA                       | 1293 | EURAZEO                                 |
| 1294 | EUROCASTLE INVESTMENT LTD             | 1295 | EUROFINS SCIENTIFIC                   | 1296 | EUROHYPO AG                             |
| 1297 | EURO-KAI KGAA                         | 1298 | EURONAV NV                            | 1299 | EURONET WORLDWIDE INC                   |
| 1300 | EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE           | 1301 | EVEREST RE GROUP LTD                  | 1302 | EVERGREEN SOLAR INC                     |
| 1303 | EVERTZ TECHNOLOGIES LTD               | 1304 | EVN AG                                | 1305 | EVS BROADCAST EQUIPMENT SA              |
| 1306 | EW SCRIPPS CO-CL A                    | 1307 | EXCO RESOURCES INC                    | 1308 | EXEDY CORP                              |
| 1309 | EXELON CORP                           | 1310 | EXIDE INDUSTRIES LTD                  | 1311 | EXISTA HF                               |
| 1312 | EXPEDIA INC                           | 1313 | EXPEDITORS INTL WASH INC              | 1314 | EXPERIAN GROUP LTD                      |
| 1315 | EXPRESS SCRIPTS INC                   | 1316 | EXPRO INTERNATIONAL GRP PLC           | 1317 | EXTERRAN HOLDINGS INC                   |
| 1318 | EXXARO RESOURCES LTD                  | 1319 | EXXON MOBIL CORP                      | 1320 | EZAKI GLICO CO LTD                      |
| 1321 | F5 NETWORKS INC                       | 1322 | FABEGE AB                             | 1323 | FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC            |
| 1324 | FAES FARMA SA                         | 1325 | FAIR ISAAC CORP                       | 1326 | FAIRCHILD SEMICON INTERNATIO            |
| 1327 | FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD           | 1328 | FAIRFAX MEDIA LTD                     | 1329 | FAMILY DOLLAR STORES                    |
| 1330 | FAMILYMART CO LTD                     | 1331 | FANNIE MAE                            | 1332 | FANUC LTD                               |
| 1333 | FAST RETAILING CO LTD                 | 1334 | FASTENAL CO                           | 1335 | FAURECIA                                |
| 1336 | FCSTONE GROUP INC                     | 1337 | FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION | 1338 | FEDERAL REALTY INVS TRUST               |
| 1339 | FEDERATED INVESTORS INC-CL B          | 1340 | FEDEX CORP                            | 1341 | FEEC                                    |
| 1342 | FIAT SPA                              | 1343 | FIDELITY NATIONAL FINL-A              | 1344 | FIDELITY NATIONAL INFORMATIO            |

| 項次   | 股票名稱                              | 項次   | 股票名稱                             | 項次   | 股票名稱                                 |
|------|-----------------------------------|------|----------------------------------|------|--------------------------------------|
| 1345 | FIELMANN AG                       | 1346 | FIFTH POWER GENERATION CO        | 1347 | FIFTH THIRD BANCORP                  |
| 1348 | FINANCIAL TECHNOLOGIES INDIA LTD  | 1349 | FINMECCANICA SPA                 | 1350 | FINNING INTERNATIONAL INC            |
| 1351 | FIRST AMERICAN CORPORATION        | 1352 | FIRST CAPITAL REALTY INC         | 1353 | FIRST CITIZENS BCSHS -CL A           |
| 1354 | FIRST HORIZON NATIONAL CORP       | 1355 | FIRST INDUSTRIAL REALTY TR       | 1356 | FIRST INLAND BANK                    |
| 1357 | FIRST MARBLEHEAD CORP/THE         | 1358 | FIRST MIDWEST BANCORP INC/IL     | 1359 | FIRST NIAGARA FINANCIAL GRP          |
| 1360 | FIRST QUANTUM MINERALS LTD        | 1361 | FIRST SOLAR INC                  | 1362 | FIRSTENERGY CORP                     |
| 1363 | FIRSTGROUP PLC                    | 1364 | FIRSTMERIT CORP                  | 1365 | FIRSTRAND LTD                        |
| 1366 | FISCHER (GEORG)-REG               | 1367 | FISERV INC                       | 1368 | FKP PROPERTY GROUP                   |
| 1369 | FL GROUP HF                       | 1370 | FLAGSTONE REINSURANCE HOLDIN     | 1371 | FLETCHER BUILDING LTD                |
| 1372 | FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD     | 1373 | FLIGHT CENTRE LIMITED            | 1374 | FLIR SYSTEMS INC                     |
| 1375 | FLOWERS FOODS INC                 | 1376 | FLOWSERVE CORP                   | 1377 | FLSMIDTH & CO A/S                    |
| 1378 | FLUGHAFEN WIEN AG                 | 1379 | FLUGHAFEN ZUERICH AG             | 1380 | FLUOR CORP                           |
| 1381 | FMC CORP                          | 1382 | FMC TECHNOLOGIES INC             | 1383 | FNX MINING CO INC                    |
| 1384 | FOCUS ENERGY TRUST-UTS            | 1385 | FOMENTO DE CONSTRUCC Y CONTRA    | 1386 | FONCIERE DES MURS                    |
| 1387 | FONCIERE DES REGIONS              | 1388 | FONCIERE DEVELOPPEMENT LOGEMENTS | 1389 | FONDIARIA-SAI SPA                    |
| 1390 | FOOT LOCKER INC                   | 1391 | FORBO HOLDING AG                 | 1392 | FORD MOTOR CO                        |
| 1393 | FORDING CANADIAN COAL TRUST       | 1394 | FOREST CITY ENTERPRISES-CL A     | 1395 | FOREST LABORATORIES INC              |
| 1396 | FOREST OIL CORP                   | 1397 | FORMUEPLEJE PENTA A/S            | 1398 | FORT CHICAGO ENERGY-CLASS A          |
| 1399 | FORTESCUE METALS GROUP LTD        | 1400 | FORTH PORTS PLC                  | 1401 | FORTIS                               |
| 1402 | FORTIS INC                        | 1403 | FORTRESS INVESTMENT GROUP LLC    | 1404 | FORTUM OYJ                           |
| 1405 | FORTUNE BRANDS INC                | 1406 | FOSSIL INC                       | 1407 | FOSTER WHEELER LTD                   |
| 1408 | FOSTER'S GROUP LTD                | 1409 | FOUNDATION COAL HOLDINGS INC     | 1410 | FOUNDRY NETWORKS INC                 |
| 1411 | FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS       | 1412 | FPL GROUP INC                    | 1413 | FRANCE TELECOM SA                    |
| 1414 | FRANKLIN RESOURCES INC            | 1415 | FRAPORT AG                       | 1416 | FRASER AND NEAVE LTD                 |
| 1417 | FRED OLSEN ENERGY ASA             | 1418 | FREDDIE MAC                      | 1419 | FREEMPORT-MCMORAN COPPER & GOLD, INC |
| 1420 | FRESENIUS MEDICAL CARE AG &       | 1421 | FRESENIUS MEDICAL CARE-ADR       | 1422 | FRESENIUS SE                         |
| 1423 | FRESH DEL MONTE PRODUCE INC       | 1424 | FRIENDS PROVIDENT PLC            | 1425 | FRIGOLASS SA                         |
| 1426 | FROMAGERIES BEL SA                | 1427 | FRONTIER OIL CORP                | 1428 | FRONTLINE LTD                        |
| 1429 | FTI CONSULTING INC                | 1430 | FUGRO NV-CVA                     | 1431 | FUJI ELECTRIC HOLDINGS CO LT         |
| 1432 | FUJI FIRE & MARINE INSURANCE      | 1433 | FUJI HEAVY INDUSTRIES LTD        | 1434 | FUJI TELEVISION NETWORK INC          |
| 1435 | FUJIFILM HOLDINGS CORP            | 1436 | FUJIFILM HOLDINGS CORP-ADR       | 1437 | FUJIKURA LTD                         |
| 1438 | FUJITSU LTD                       | 1439 | FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC      | 1440 | FUKUYAMA TRANSPORTING CO LTD         |
| 1441 | FULTON FINANCIAL CORP             | 1442 | FURUKAWA ELECTRIC CO LTD/THE     | 1443 | FUTABA INDUSTRIAL CO LTD             |
| 1444 | FUTURIS CORPORATION LIMITED       | 1445 | G4S PLC                          | 1446 | GAFISA SA-ADR                        |
| 1447 | GAGFAH SA                         | 1448 | GAIL INDIA LTD                   | 1449 | GALLANT VENTURE LTD                  |
| 1450 | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS       | 1451 | GAMCO INVESTORS INC-A            | 1452 | GAME GROUP PLC                       |
| 1453 | GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA SA | 1454 | GAMESTOP CORP-CLASS A            | 1455 | GAMMON INDIA LTD                     |
| 1456 | GAMUDA BHD                        | 1457 | GANNETT CO                       | 1458 | GAP INC/THE                          |
| 1459 | GARDNER DENVER INC                | 1460 | GARMIN LTD                       | 1461 | GARTNER INC                          |
| 1462 | GAS NATURAL SDG SA                | 1463 | GATX CORP                        | 1464 | GAYLORD ENTERTAINMENT CO             |
| 1465 | GAZ DE FRANCE                     | 1466 | GAZIT GLOBE LTD                  | 1467 | GAZPROM OAO                          |
| 1468 | GAZPROMNEFT                       | 1469 | GEA GROUP AG                     | 1470 | GEBERIT AG                           |
| 1471 | GECINA SA                         | 1472 | GELSENWASSER AG                  | 1473 | GEMALTO NV                           |
| 1474 | GEMINA SPA                        | 1475 | GEMSTAR-TV GUIDE INTL INC        | 1476 | GENCO SHIPPING & TRADING LTD         |
| 1477 | GENENTECH INC                     | 1478 | GENERAL CABLE CORP               | 1479 | GENERAL DYNAMICS CORP                |
| 1480 | GENERAL ELECTRIC CO               | 1481 | GENERAL GROWTH PROPERTIES        | 1482 | GENERAL MILLS INC                    |
| 1483 | GENERAL MOTORS CORP               | 1484 | GENERALE DE SANTE                | 1485 | GENMAB A/S                           |
| 1486 | GENPACT LTD                       | 1487 | GEN-PROBE INC                    | 1488 | GENTEX CORP                          |
| 1489 | GENTING BHD                       | 1490 | GENTING INTERNATIONAL PLC        | 1491 | GENUINE PARTS CO                     |
| 1492 | GENWORTH FINANCIAL INC-CL A       | 1493 | GENZYME CORP                     | 1494 | GEO GROUP INC/THE                    |
| 1495 | GEORG FISCHER AG                  | 1496 | GEORGE WESTON LTD                | 1497 | GEOX SPA                             |
| 1498 | GERDAU AMERISTEEL CORP            | 1499 | GERDAU SA                        | 1500 | GERRESHEIMER AG                      |
| 1501 | GESTEVISION TELECINCO SA          | 1502 | GETINGE AB-B SHS                 | 1503 | GETTY IMAGES INC                     |
| 1504 | GFI GROUP INC                     | 1505 | GFK AG                           | 1506 | GILDAN ACTIVEWEAR INC                |
| 1507 | GILEAD SCIENCES INC               | 1508 | GIMV NV                          | 1509 | GIVAUDAN-REG                         |
| 1510 | GKN PLC                           | 1511 | GLANBIA PLC                      | 1512 | GLAXOSMITHKLINE PLC                  |
| 1513 | GLG PARTNERS INC                  | 1514 | GLITNIR BANKI HF                 | 1515 | GLOBAL CROSSING LTD                  |
| 1516 | GLOBAL INDUSTRIES LTD             | 1517 | GLOBAL PAYMENTS INC              | 1518 | GLOBE TRADE CENTRE SA                |
| 1519 | GLOBEX UTILIDADES SA              | 1520 | GLORY LTD                        | 1521 | GLOVIS CO LTD                        |
| 1522 | GLOW ENERGY PCL                   | 1523 | GMARKET INC-ADR                  | 1524 | GMP CAPITAL TRUST                    |
| 1525 | GMR INFRASTRUCTURE LTD            | 1526 | GN STORE NORD A/S                | 1527 | GO-AHEAD GROUP PLC                   |
| 1528 | GODREJ INDUSTRIES LTD             | 1529 | GOL LINHAS AEREAS INTEL-ADR      | 1530 | GOLAR LNG LTD                        |
| 1531 | GOLD FIELDS LTD                   | 1532 | GOLD FIELDS LTD-SPONS ADR        | 1533 | GOLDCORP INC                         |
| 1534 | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD         | 1535 | GOLDEN TELECOM INC               | 1536 | GOLDMAN SACHS GROUP INC              |

| 項次   | 股票名稱                                     | 項次   | 股票名稱                                     | 項次   | 股票名稱                                     |
|------|--|------|--|------|--|
| 1537 | GOODMAN FIELDER LTD                      | 1538 | GOODMAN GLOBAL INC                       | 1539 | GOODMAN GROUP                            |
| 1540 | GOODRICH CORP                            | 1541 | GOODYEAR TIRE & RUBBER CO                | 1542 | GOOGLE INC-CL A                          |
| 1543 | GPT GROUP                                | 1544 | GRACO INC                                | 1545 | GRAFTECH INTERNATIONAL LTD               |
| 1546 | GRAFTON GRP PLC-UTS                      | 1547 | GRANITE CONSTRUCTION INC                 | 1548 | GRANT PRIDECO INC                        |
| 1549 | GRASIM INDUSTRIES LTD                    | 1550 | GREAT ATLANTIC & PAC TEA CO              | 1551 | GREAT CANADIAN GAMING CORP               |
| 1552 | GREAT PLAINS ENERGY INC                  | 1553 | GREAT-WEST LIFECO INC                    | 1554 | GREENE KING PLC                          |
| 1555 | GREENHILL & CO INC                       | 1556 | GREIF INC                                | 1557 | GRENDENE SA                              |
| 1558 | GREY WOLF INC                            | 1559 | GRIFOLS SA                               | 1560 | GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA              |
| 1561 | GROUPE DANONE                            | 1562 | GRUMA S.A.B.-SPONSORED ADR               | 1563 | GRUMA SAB DE CV                          |
| 1564 | GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO NORTE SAB | 1565 | GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SA DE C | 1566 | GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE C |
| 1567 | GRUPO AEROPORTUARIO DEL-ADR              | 1568 | GRUPO AEROPORTUARIO SUR-ADR              | 1569 | GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES            |
| 1570 | GRUPO BIMBO SAB DE CV                    | 1571 | GRUPO CATALANA OCCIDENTE SA              | 1572 | GRUPO CEMENTOS DE CHIHUAHUA SAB DE CV    |
| 1573 | GRUPO ELEKTRA SA DE CV                   | 1574 | GRUPO EMPRESARIAL ENCE SA                | 1575 | GRUPO FAMSA SAB DE CV                    |
| 1576 | GRUPO FERROVIAL                          | 1577 | GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV       | 1578 | GRUPO FINANCIERO INBURSA SA              |
| 1579 | GRUPO MEXICO SAB DE CV                   | 1580 | GRUPO MODELO SAB DE CV                   | 1581 | GRUPO NACIONAL DE CHOCOLATES SA          |
| 1582 | GRUPO TELEVISA SA                        | 1583 | GRUPO TELEVISA SA-SPONS ADR              | 1584 | GS ENGINEERING & CONSTRUCTION CORP       |
| 1585 | GS HOLDINGS CORP                         | 1586 | GTC REAL ESTATE NV                       | 1587 | GUARARAPES CONFECcoes SA                 |
| 1588 | GUESS? INC                               | 1589 | GULF BANK KSC                            | 1590 | GULF CABLE & ELECTRICAL IND              |
| 1591 | GULF CEMENT CO                           | 1592 | GULF GENERAL INVESTMENT CO               | 1593 | GUNMA BANK LTD/THE                       |
| 1594 | GUNNS LIMITED                            | 1595 | GUOCOLAND LTD                            | 1596 | GYMBOREE CORP                            |
| 1597 | H LUNDBECK A/S                           | 1598 | H&R BLOCK INC                            | 1599 | H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS             |
| 1600 | H.B. FULLER CO.                          | 1601 | H2O RETAILING CORP                       | 1602 | HACHIJUNI BANK LTD/THE                   |
| 1603 | HAEMONETICS CORP/MASS                    | 1604 | HAFSLUND ASA-A SHS                       | 1605 | HAGEMEYER NV                             |
| 1606 | HAIN CELESTIAL GROUP INC                 | 1607 | HAKON INVEST AB                          | 1608 | HAKUHODO DY HOLDINGS INC                 |
| 1609 | HALFORDS GROUP PLC                       | 1610 | HALLIBURTON CO                           | 1611 | HALMA PLC                                |
| 1612 | HAMAMATSU PHOTONICS KK                   | 1613 | HAMMERSON PLC                            | 1614 | HANA FINANCIAL GROUP                     |
| 1615 | HANAROTELECOM INC                        | 1616 | HANCOCK HOLDING CO                       | 1617 | HANESBRANDS INC                          |
| 1618 | HANG LUNG PROPERTIES LTD                 | 1619 | HANG SENG BANK LTD                       | 1620 | HANJIN HEAVY INDUS & CONST               |
| 1621 | HANJIN SHIPPING                          | 1622 | HANKOOK TIRE CO LTD                      | 1623 | HANKYU HANSHIN HOLDINGS INC              |
| 1624 | HANMI PHARM CO LTD                       | 1625 | HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG             | 1626 | HANOVER INSURANCE GROUP INC/             |
| 1627 | HANSEN NATURAL CORPORATION               | 1628 | HANWHA CHEMICAL CORP                     | 1629 | HANWHA CORPORATION                       |
| 1630 | HARLEY-DAVIDSON INC                      | 1631 | HARLEYSVILLE GROUP INC                   | 1632 | HARMAN INTERNATIONAL                     |
| 1633 | HARMONY GOLD MNG-SPON ADR                | 1634 | HARRAH'S ENTERTAINMENT INC               | 1635 | HARRIS CORP                              |
| 1636 | HARRY WINSTON DIAMOND CORP               | 1637 | HARSCO CORP                              | 1638 | HARTE-HANKS INC                          |
| 1639 | HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP              | 1640 | HARVEST ENERGY TRUST-UNITS               | 1641 | HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD               |
| 1642 | HASBRO INC                               | 1643 | HASEKO CORP                              | 1644 | HAVAS SA                                 |
| 1645 | HAWAIIAN ELECTRIC INDS                   | 1646 | HAYS PLC                                 | 1647 | HB FULLER CO                             |
| 1648 | HBOS PLC                                 | 1649 | HCC INSURANCE HOLDINGS INC               | 1650 | HCL TECHNOLOGIES LTD                     |
| 1651 | HCP INC                                  | 1652 | HDFC BANK LTD                            | 1653 | HDFC BANK LTD-ADR                        |
| 1654 | HEALTH CARE REIT INC                     | 1655 | HEALTH MGMT ASSOCIATES INC-A             | 1656 | HEALTH NET INC                           |
| 1657 | HEALTHCARE REALTY TRUST INC              | 1658 | HEALTHCARE SERVICES GROUP                | 1659 | HEALTHEXTRAS INC                         |
| 1660 | HEALTHSCOPE LTD                          | 1661 | HEALTHSOUTH CORP                         | 1662 | HEALTHSPRING INC                         |
| 1663 | HEALTHWAYS INC                           | 1664 | HEARST-ARGYLE TELEVISION INC             | 1665 | HEARTLAND EXPRESS INC                    |
| 1666 | HECLA MINING CO                          | 1667 | HEIDELBERGCEMENT AG                      | 1668 | HEIDELBERGER DRUCKMASCHINEN              |
| 1669 | HEINEKEN HOLDING NV                      | 1670 | HEINEKEN NV                              | 1671 | HEIWA CORP                               |
| 1672 | HELIOPOLIS HOUSING                       | 1673 | HELIX ENERGY SOLUTIONS GROUP             | 1674 | HELLENIC TECHNODOMIKI TEV SA             |
| 1675 | HELLENIC TELECOM ORG-SP ADR              | 1676 | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA             | 1677 | HELMERICH & PAYNE                        |
| 1678 | HENDERSON GROUP PLC-CDI                  | 1679 | HENDERSON DEVELOPMENT LAND               | 1680 | HENKEL KGAA-VORZUG                       |
| 1681 | HENNES & MAURITZ AB-B SHS                | 1682 | HENRY SCHEIN INC                         | 1683 | HERBALIFE LTD                            |
| 1684 | HERCULES INC                             | 1685 | HERCULES OFFSHORE INC                    | 1686 | HERMAN MILLER INC                        |
| 1687 | HERMES INTERNATIONAL                     | 1688 | HERO HONDA MOTORS LTD                    | 1689 | HERSHEY CO/THE                           |
| 1690 | HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC                | 1691 | HESS CORP                                | 1692 | HEWITT ASSOCIATES INC-CL A               |
| 1693 | HEWLETT-PACKARD CO                       | 1694 | HEXAGON AB-B SHS                         | 1695 | HEXCEL CORP                              |
| 1696 | HIGHVELD STEEL AND VANAD-ADR             | 1697 | HIGHWOODS PROPERTIES INC                 | 1698 | HIGO BANK LTD/THE                        |
| 1699 | HIKARI TSUSHIN INC                       | 1700 | HILB ROGAL & HOBBS CO                    | 1701 | HILLENBRAND INDUSTRIES                   |
| 1702 | HINDALCO INDUSTRIES LTD                  | 1703 | HINDUSTAN COPPER LTD                     | 1704 | HINDUSTAN UNILEVER LTD                   |
| 1705 | HINDUSTAN ZINC LTD                       | 1706 | HINO MOTORS LTD                          | 1707 | HIROSE ELECTRIC CO LTD                   |
| 1708 | HIROSHIMA BANK LTD/THE                   | 1709 | HISAMITSU PHARMACEUTICAL CO              | 1710 | HITACHI CABLE LTD                        |
| 1711 | HITACHI CAPITAL CORP                     | 1712 | HITACHI CHEMICAL CO LTD                  | 1713 | HITACHI CONSTRUCTION MACHINE             |
| 1714 | HITACHI HIGH-TECHNOLOGIES CO             | 1715 | HITACHI KOKI CO LTD                      | 1716 | HITACHI KOKUSAI ELECTRIC INC             |
| 1717 | HITACHI LTD                              | 1718 | HITACHI LTD -SPONS ADR                   | 1719 | HITACHI MAXELL LTD                       |

| 項次   | 股票名稱                             | 項次   | 股票名稱                                | 項次   | 股票名稱                                     |
|------|----------------------------------|------|-------------------------------------|------|--|
| 1720 | HITACHI METALS LTD               | 1721 | HITACHI ENGINEERING SOFTWARE        | 1722 | HITACHI TRANSPORT SYSTEM LTD             |
| 1723 | HITE BREWERY CO LTD              | 1724 | HITTITE MICROWAVE CORP              | 1725 | HJ HEINZ CO                              |
| 1726 | HLTH CORP                        | 1727 | HM SAMPOERNA TBK PT                 | 1728 | HNI CORP                                 |
| 1729 | HOCHSCHILD MINING PLC            | 1730 | HOCHTIEF AG                         | 1731 | HOKKAIDO ELECTRIC POWER CO               |
| 1732 | HOKKOKU BANK LTD/THE             | 1733 | HOKUHOKU FINANCIAL GROUP INC        | 1734 | HOKURIKU ELECTRIC POWER CO               |
| 1735 | HOLCIM LTD-REG                   | 1736 | HOLCIM PHILIPPINES INC              | 1737 | HOLLY CORP                               |
| 1738 | HOLMEN AB-B SHARES               | 1739 | HOLOGIC INC                         | 1740 | HOME CAPITAL GROUP INC                   |
| 1741 | HOME DEPOT INC                   | 1742 | HOME PROPERTIES INC                 | 1743 | HOME RETAIL GROUP                        |
| 1744 | HOMESERVE PLC                    | 1745 | HONAM PETROCHEMICAL CORP            | 1746 | HONDA MOTOR CO LTD                       |
| 1747 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC      | 1748 | HONG KONG & CHINA GAS               | 1749 | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR              |
| 1750 | HONG LEONG BANK BERHAD           | 1751 | HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS          | 1752 | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD               |
| 1753 | HORIBA LTD                       | 1754 | HORMEL FOODS CORP                   | 1755 | HORNBECK OFFSHORE SERVICES               |
| 1756 | HOSIDEN CORP                     | 1757 | HOSKEN CONSOLIDATED INVESTMENTS LTD | 1758 | HOSPIRA INC                              |
| 1759 | HOSPITALITY PROPERTIES TRUST     | 1760 | HOST HOTELS & RESORTS INC           | 1761 | HOTEL PROPERTIES LTD                     |
| 1762 | HOTEL SHILLA CO LTD              | 1763 | HOUSE FOODS CORPORATION             | 1764 | HOUSING DEVELOPMENT & INFRASTRUCTURE LTD |
| 1765 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP | 1766 | HOYA CORP                           | 1767 | HRPT PROPERTIES TRUST                    |
| 1768 | HSBC HOLDINGS PLC                | 1769 | HSBC HOLDINGS PLC (UK REG)          | 1770 | HSBC HOLDINGS PLC-SPONS ADR              |
| 1771 | HUB GROUP INC-CL A               | 1772 | HUBBELL INC -CL A                   | 1773 | HUBER & SUHNER AG                        |
| 1774 | HUDBAY MINERALS INC              | 1775 | HUDSON CITY BANCORP INC             | 1776 | HUFVUDSTADEN AB                          |
| 1777 | HUGO BOSS AG                     | 1778 | HUHTAMAKI OYJ                       | 1779 | HUMANA INC                               |
| 1780 | HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC      | 1781 | HUNTER DOUGLAS NV                   | 1782 | HUNTINGTON BANCSHARES INC                |
| 1783 | HUNTSMAN CORP                    | 1784 | HURON CONSULTING GROUP INC          | 1785 | HUSKY ENERGY INC                         |
| 1786 | HUSQVARNA AB-B SHS               | 1787 | HUTCHISON TELECOMMUNICAT-ADR        | 1788 | HUTCHISON WHAMPOA LTD                    |
| 1789 | HWANGE COLLIERY CO LTD           | 1790 | HYAKUGO BANK LTD/THE                | 1791 | HYAKUJUSHI BANK LTD/THE                  |
| 1792 | HYFLUX LTD                       | 1793 | HYNIX SEMICONDUCTOR INC             | 1794 | HYOSUNG CORPORATION                      |
| 1795 | HYPO REAL ESTATE HOLDING         | 1796 | HYUNDAI AUTONET CO LTD              | 1797 | HYUNDAI DEPT STORE CO                    |
| 1798 | HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY      | 1799 | HYUNDAI ENGINEERING & CONST         | 1800 | HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR             |
| 1801 | HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES         | 1802 | HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO        | 1803 | HYUNDAI MERCHANT MARINE                  |
| 1804 | HYUNDAI MIPO DOCKYARD            | 1805 | HYUNDAI MOBIS                       | 1806 | HYUNDAI MOTOR CO                         |
| 1807 | HYUNDAI SECURITIES CO            | 1808 | HYUNDAI STEEL CO                    | 1809 | IAC/INTERACTIVECORP                      |
| 1810 | IAMGOLD CORP                     | 1811 | IAWS GROUP PLC                      | 1812 | IBERDROLA RENOVABLES                     |
| 1813 | IBERDROLA SA                     | 1814 | IBERIA LINEAS AER DE ESPANA         | 1815 | IBIDEN CO LTD                            |
| 1816 | ICADE                            | 1817 | ICAP PLC                            | 1818 | ICICI BANK LTD                           |
| 1819 | ICICI BANK LTD-SPON ADR          | 1820 | ICON PLC                            | 1821 | ICON PLC - SPONSORED ADR                 |
| 1822 | ICONIX BRAND GROUP INC           | 1823 | IDACORP INC                         | 1824 | IDB DEVELOPMENT CORP LTD                 |
| 1825 | IDEA CELLULAR LTD                | 1826 | IDEARC INC                          | 1827 | IDEMITSU KOSAN CO LTD                    |
| 1828 | IDEX CORP                        | 1829 | IDEXX LABORATORIES INC              | 1830 | IDFC LTD                                 |
| 1831 | IFA HOTELS & RESORTS             | 1832 | IFIL-INVESTMENTS SPA                | 1833 | I-FLEX SOLUTIONS LTD                     |
| 1834 | IG GROUP HOLDINGS PLC            | 1835 | IGB CORPORATION BHD                 | 1836 | IGM FINANCIAL INC                        |
| 1837 | IHI CORP                         | 1838 | IHS INC-CLASS A                     | 1839 | IJM CORP BHD                             |
| 1840 | ILIAD SA                         | 1841 | ILLINOIS TOOL WORKS                 | 1842 | ILLUMINA INC                             |
| 1843 | IMCLONE SYSTEMS                  | 1844 | IMERY'S SA                          | 1845 | IMI PLC                                  |
| 1846 | IMMEUBLES DE FRANCE              | 1847 | IMMOEAST AG                         | 1848 | IMMOFINANZ AG                            |
| 1849 | IMMUCOR INC                      | 1850 | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD        | 1851 | IMPERIAL HOTEL LTD                       |
| 1852 | IMPERIAL OIL LTD                 | 1853 | IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC          | 1854 | IMPERIAL TOBACCO GROUP-ADR               |
| 1855 | IMPREGILO SPA                    | 1856 | IMS HEALTH INC                      | 1857 | INBEV NV                                 |
| 1858 | INCHCAPE PLC                     | 1859 | INCITEC PIVOT LTD                   | 1860 | INDESIT CO SPA                           |
| 1861 | INDIA CEMENTS LTD                | 1862 | INDIABULLS FINANCIAL SERVICES LTD   | 1863 | INDIABULLS REAL ESTATE LTD               |
| 1864 | INDIAN HOTELS CO LTD             | 1865 | INDITEX                             | 1866 | INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT       |
| 1867 | INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT    | 1868 | INDRA SISTEMAS SA                   | 1869 | INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC             |
| 1870 | INDUSTRIAL BANK OF KOREA         | 1871 | INDUSTRIAS BACHOCO SAB DE CV        | 1872 | INDUSTRIAS BACHOCO SAB SP AD             |
| 1873 | INDUSTRIAS CH SAB DE CV          | 1874 | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV        | 1875 | INDUSTRIES QATAR                         |
| 1876 | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS          | 1877 | INERGY LP                           | 1878 | INFINEON TECHNOLOGIES AG                 |
| 1879 | INFORMA PLC                      | 1880 | INFORMATICA CORP                    | 1881 | INFOSYS TECHNOLOGIES LTD                 |
| 1882 | INFOSYS TECHNOLOGIES-SP ADR      | 1883 | ING CANADA INC                      | 1884 | ING GROEP NV-CVA                         |
| 1885 | ING INDUSTRIAL FUND              | 1886 | ING OFFICE FUND                     | 1887 | INGERSOLL-RAND CO LTD-CL A               |
| 1888 | INGRAM MICRO INC-CL A            | 1889 | INMARSAT PLC                        | 1890 | INMET MINING CORPORATION                 |
| 1891 | INMOBILIARIA COLONIAL SA         | 1892 | INPEX HOLDINGS INC                  | 1893 | INSURANCE AUSTRALIA GROUP                |
| 1894 | INTEGRA LIFESCIENCES HOLDING     | 1895 | INTEGRATED DEVICE TECH INC          | 1896 | INTEGRYS ENERGY GROUP INC                |
| 1897 | INTEL CORP                       | 1898 | INTER PIPELINE FUND LP-A            | 1899 | INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A             |
| 1900 | INTERACTIVE DATA CORP            | 1901 | INTERCELL AG                        | 1902 | INTERCONTINENTAL HOTELS GROU             |
| 1903 | INTERCONTINENTALEXCHANGE INC     | 1904 | INTERMEC INC                        | 1905 | INTERMEDIATE CAPITAL GROUP               |
| 1906 | INTERNATIONAL BANCSHARES CRP     | 1907 | INTERNATIONAL BUSINESS              | 1908 | INTERNATIONAL CONTAINER                  |

| 項次   | 股票名稱                                  | 項次   | 股票名稱                                   | 項次   | 股票名稱                                    |
|------|---------------------------------------|------|--|------|---|
|      |                                       |      | MACHINES CORP                          |      | TERM SERVICES IN                        |
| 1909 | INTERNATIONAL FINANCIAL ADVISORS      | 1910 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC | 1911 | INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY           |
| 1912 | INTERNATIONAL NICKEL INDONESIA TBK PT | 1913 | INTERNATIONAL PAPER CO                 | 1914 | INTERNATIONAL POWER PLC                 |
| 1915 | INTERNATIONAL RECTIFIER CORP          | 1916 | INTERNATIONAL SPEEDWAY CORP            | 1917 | INTERPIPE NIZHNODNIPROVSKY PIPE ROLLING |
| 1918 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC          | 1919 | INTERSERVE PLC                         | 1920 | INTERSIL CORP -CL A                     |
| 1921 | INTERTEK GROUP PLC                    | 1922 | INTESA SANPAOLO                        | 1923 | INTL BUSINESS MACHINES CORP             |
| 1924 | INTL FLAVORS & FRAGRANCES             | 1925 | INTL GAME TECHNOLOGY                   | 1926 | INTL RECTIFIER CORP                     |
| 1927 | INTL SPEEDWAY CORP-CL A               | 1928 | INTRALOT SA                            | 1929 | INTUIT INC                              |
| 1930 | INTUITIVE SURGICAL INC                | 1931 | INVENSYS PLC                           | 1932 | INVERCAP SA                             |
| 1933 | INVERNESS MEDICAL INNOVATION          | 1934 | INVERSIONES ARGOS SA                   | 1935 | INVESCO LTD                             |
| 1936 | INVESTEC PLC                          | 1937 | INVESTMENT DAR CO                      | 1938 | INVESTMENT TECHNOLOGY GROUP             |
| 1939 | INVESTOR AB-B SHS                     | 1940 | INVESTORS BANCORP INC                  | 1941 | INVITROGEN CORP                         |
| 1942 | IOI CORPORATION BHD                   | 1943 | IOI PROPERTIES BHD                     | 1944 | ION GEOPHYSICAL CORP                    |
| 1945 | IPC HOLDINGS LTD                      | 1946 | IPSEN                                  | 1947 | IRISH LIFE & PERMANENT PLC              |
| 1948 | IRKUTSKENERGO OJSC                    | 1949 | IRON MOUNTAIN INC                      | 1950 | IRPC PCL                                |
| 1951 | ISETAN CO LTD                         | 1952 | ISIS PHARMACEUTICALS INC               | 1953 | ISRAEL CHEMICALS LTD                    |
| 1954 | ISRAEL CORP LTD/THE                   | 1955 | ISTAR FINANCIAL INC                    | 1956 | ISUZU MOTORS LTD                        |
| 1957 | ITALCEMENTI SPA                       | 1958 | ITALIAN-THAI DEVELOPMENT PCL           | 1959 | ITALMOBILIARE SPA                       |
| 1960 | ITC HOLDINGS CORP                     | 1961 | ITC LTD                                | 1962 | ITINERE INFRAESTRUCTURA SA              |
| 1963 | ITO EN LTD                            | 1964 | ITOCHU CORP                            | 1965 | ITOCHU TECHNO-SOLUTIONS CORP            |
| 1966 | ITOHAM FOODS INC                      | 1967 | ITRON INC                              | 1968 | ITT CORP                                |
| 1969 | ITT EDUCATIONAL SERVICES INC          | 1970 | ITV PLC                                | 1971 | IVANHOE MINES LTD                       |
| 1972 | IVG IMMOBILIEN AG                     | 1973 | IVRCL INFRASTRUCTURES & PROJECTS LTD   | 1974 | IYO BANK LTD/THE                        |
| 1975 | IZUMI CO LTD                          | 1976 | J CREW GROUP INC                       | 1977 | J FRONT RETAILING CO LTD                |
| 1978 | J SAINSBURY PLC                       | 1979 | J.C. PENNEY CO INC                     | 1980 | J.P. MORGAN CHASE & CO.                 |
| 1981 | JABIL CIRCUIT INC                     | 1982 | JACK HENRY & ASSOCIATES INC            | 1983 | JACK IN THE BOX INC                     |
| 1984 | JACOBS ENGINEERING GROUP INC          | 1985 | JAFCO CO LTD                           | 1986 | JAIPRAKASH ASSOCIATES LTD               |
| 1987 | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI           | 1988 | JANUS CAPITAL GROUP INC                | 1989 | JAPAN AIRLINES CORP                     |
| 1990 | JAPAN AIRPORT TERMINAL CO             | 1991 | JAPAN AVIATION ELECTRONICS             | 1992 | JAPAN PETROLEUM EXPLORATION             |
| 1993 | JAPAN STEEL WORKS LTD                 | 1994 | JAPAN TOBACCO INC                      | 1995 | JARDEN CORP                             |
| 1996 | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD          | 1997 | JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD            | 1998 | JAYBHARAT TEXTILES & REAL ESTATE LTD    |
| 1999 | JB HI-FI LTD                          | 2000 | JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC         | 2001 | JC DECAUX SA                            |
| 2002 | JDS UNIPHASE CORP                     | 2003 | JEAN COUTU GROUP INC A                 | 2004 | JEFFERIES GROUP INC (NEW)               |
| 2005 | JELMOLI HOLDING AG                    | 2006 | JERONIMO MARTINS SGPS SA               | 2007 | JFE HOLDINGS INC                        |
| 2008 | JFE SHOJI HOLDINGS INC                | 2009 | JGC CORP                               | 2010 | JHSF PARTICIPACOES SA                   |
| 2011 | JINDAL STEEL & POWER LTD              | 2012 | JM AB                                  | 2013 | JM SMUCKER CO/THE-NEW COMMON            |
| 2014 | JOHN WOOD GROUP PLC                   | 2015 | JOHNSON & JOHNSON                      | 2016 | JOHNSON CONTROLS INC                    |
| 2017 | JOHNSON ELECTRIC HOLDINGS LTD         | 2018 | JOHNSON MATTHEY PLC                    | 2019 | JONES APPAREL GROUP INC                 |
| 2020 | JONES LANG LASALLE INC                | 2021 | JOY GLOBAL INC                         | 2022 | JOYO BANK LTD/THE                       |
| 2023 | JPMORGAN CHASE & CO                   | 2024 | JS GROUP CORP                          | 2025 | JSR CORP                                |
| 2026 | JTEKT CORP                            | 2027 | JUBILEE MINES NL                       | 2028 | JULIUS BAER HOLDING AG-REG              |
| 2029 | JUMBO SA                              | 2030 | JUNIPER NETWORKS INC                   | 2031 | JUPITER TELECOMMUNICATIONS CO LTD       |
| 2032 | JUROKU BANK LTD/THE                   | 2033 | JYSKE BANK-REG                         | 2034 | K V PHARMACEUTICAL CO-CL B              |
| 2035 | K+S AG                                | 2036 | KABA HOLDING AG                        | 2037 | KABU.COM SECURITIES CO LTD              |
| 2038 | KAGOME CO LTD                         | 2039 | KAGOSHIMA BANK LTD/THE                 | 2040 | KAISER ALUMINUM CORP                    |
| 2041 | KAJIMA CORP                           | 2042 | KALI CHEMIE AG                         | 2043 | KAMIGUMI CO LTD                         |
| 2044 | KANDENKO CO LTD                       | 2045 | KANEKA CORP                            | 2046 | KANGWON LAND INC                        |
| 2047 | KANSAI ELECTRIC POWER CO INC          | 2048 | KANSAI PAINT CO LTD                    | 2049 | KANSAI URBAN BANKING CORP               |
| 2050 | KANSAS CITY SOUTHERN                  | 2051 | KAO CORP                               | 2052 | KASIKORNBANK PCL                        |
| 2053 | KATOKICHI CO LTD                      | 2054 | KAUPTHING BANK                         | 2055 | KAWASAKI HEAVY INDUSTRIES               |
| 2056 | KAWASAKI KISEN KAISHA LTD             | 2057 | KAYDON CORP                            | 2058 | KAZAKHMYN PLC                           |
| 2059 | KB HOME                               | 2060 | KBC ANCORA                             | 2061 | KBC GROEP NV                            |
| 2062 | KBR INC                               | 2063 | KCC CORP                               | 2064 | KDDI CORP                               |
| 2065 | KEIHAN ELECTRIC RAILWAY CO            | 2066 | KEIHIN CORP                            | 2067 | KEIHIN ELEC EXPRESS RAILWAY             |
| 2068 | KEIO CORP                             | 2069 | KEISEI ELECTRIC RAILWAY CO             | 2070 | KEYO BANK LTD/THE                       |
| 2071 | KELDA GROUP PLC                       | 2072 | KELLOGG CO                             | 2073 | KEMIRA OYJ                              |
| 2074 | KENNAMETAL INC                        | 2075 | KEPPEL CORP LTD                        | 2076 | KEPPEL LAND LTD                         |
| 2077 | KERRY GROUP PLC-A                     | 2078 | KESA ELECTRICALS PLC                   | 2079 | KESKO OYJ-B SHS                         |
| 2080 | KEY ENERGY SERVICES INC               | 2081 | KEYCORP                                | 2082 | KEYENCE CORP                            |
| 2083 | KEYERA FACILITIES INCOME FD           | 2084 | KGHM POLSKA MIEDZ SA                   | 2085 | KHARTSYZSKY TRUBNY Z.                   |
| 2086 | KIA MOTORS CORPORATION                | 2087 | KIKKOMAN CORP                          | 2088 | KILROY REALTY CORP                      |
| 2089 | KIMBERLY-CLARK CORP                   | 2090 | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV     | 2091 | KIMCO REALTY CORP                       |
| 2092 | KINDEN CORP                           | 2093 | KINETIC CONCEPTS INC                   | 2094 | KING PHARMACEUTICALS INC                |
| 2095 | KINGDOM HOLDING CO                    | 2096 | KINGDOM HOTEL INVESTMENTS              | 2097 | KINGFISHER PLC                          |

| 項次   | 股票名稱                         | 項次   | 股票名稱                                     | 項次   | 股票名稱                               |
|------|------------------------------|------|--|------|------------------------------------|
| 2098 | KINGSPAN GROUP PLC           | 2099 | KINNEVIK INVESTMENT AB-B                 | 2100 | KINROSS GOLD CORP                  |
| 2101 | KINTETSU CORP                | 2102 | KIRBY CORP                               | 2103 | KIRIN HOLDINGS CO LTD              |
| 2104 | KISSEI PHARMACEUTICAL CO LTD | 2105 | KIYO HOLDINGS INC                        | 2106 | KK DAVINCI ADVISORS                |
| 2107 | KKR FINANCIAL HOLDINGS LLC   | 2108 | KLA TENCOR                               | 2109 | KLABIN SA                          |
| 2110 | KLA-TENCOR CORPORATION       | 2111 | KLEPIERRE                                | 2112 | KLOECKNER & CO                     |
| 2113 | KNIGHT CAPITAL GROUP INC-A   | 2114 | KNIGHT TRANSPORTATION INC                | 2115 | KNM GROUP BHD                      |
| 2116 | KOBAYASHI PHARMACEUTICAL CO  | 2117 | KOBE STEEL LTD                           | 2118 | KOBENHAVNS LUFTHAVNE               |
| 2119 | KOEI CO LTD                  | 2120 | KOETITZER LEDERTUCH- UND WACHSTUCH-WERKE | 2121 | KOHL'S CORP                        |
| 2122 | KOITO MANUFACTURING CO LTD   | 2123 | KOKUYO CO LTD                            | 2124 | KOMATSU LTD                        |
| 2125 | KOMERCNI BANKA AS            | 2126 | KOMERI CO LTD                            | 2127 | KOMORI CORP                        |
| 2128 | KONAMI CORP                  | 2129 | KONE OYJ-B                               | 2130 | KONECRANES OYJ                     |
| 2131 | KONICA MINOLTA HOLDINGS INC  | 2132 | KONINKLIJKE AHOLD NV                     | 2133 | KONINKLIJKE BAM GROEP NV           |
| 2134 | KONINKLIJKE DSM NV           | 2135 | KONINKLIJKE KPN NV                       | 2136 | KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRONICS NV |
| 2137 | KONINKLIJKE VOPAK NV         | 2138 | KONZUM DD                                | 2139 | KOOKMIN BANK                       |
| 2140 | KOOKMIN BANK-SPON ADR        | 2141 | KOREA ELECTRIC POWER CORP                | 2142 | KOREA EXCHANGE BANK                |
| 2143 | KOREA EXPRESS CO LTD         | 2144 | KOREA GAS CORPORATION                    | 2145 | KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO       |
| 2146 | KOREA KUMHO PETROCHEMICAL CO | 2147 | KOREA LINE CORP                          | 2148 | KOREA ZINC CO LTD                  |
| 2149 | KOREAN AIR LINES CO LTD      | 2150 | KOREAN REINSURANCE CO                    | 2151 | KOSE CORP                          |
| 2152 | KRAFT FOODS INC-CLASS A      | 2153 | KRKA DD NOVO MESTO                       | 2154 | KROGER CO                          |
| 2155 | KRONES AG                    | 2156 | KRUNG THAI BANK PUB CO LTD               | 2157 | KT CORP                            |
| 2158 | KT FREETEL CO LTD            | 2159 | KT&G CORP                                | 2160 | KUALA LUMPUR KEPONG BHD            |
| 2161 | KUBOTA CORPORATION           | 2162 | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG               | 2163 | KUMBA IRON ORE LTD                 |
| 2164 | KUMHO INDUSTRIAL CO LTD      | 2165 | KUNGSLEDEN AB                            | 2166 | KUONI REISEN HOLDING AG            |
| 2167 | KURARAY CO LTD               | 2168 | KUREHA CORP                              | 2169 | KURITA WATER INDUSTRIES LTD        |
| 2170 | KUWAIT CEMENT CO             | 2171 | KUWAIT FINANCE HOUSE                     | 2172 | KUWAIT FOODS (AMERICANA)           |
| 2173 | KUWAIT INTERNATIONAL BANK    | 2174 | KUZBASSRAZREZUGOL                        | 2175 | KV PHARMACEUTICAL CO-CL A          |
| 2176 | KYOCERA CORP                 | 2177 | KYOWA HAKKO KOGYO CO LTD                 | 2178 | KYUSHU ELECTRIC POWER CO INC       |
| 2179 | L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS  | 2180 | LA SEDA DE BARCELONA-B                   | 2181 | LABORATORIOS ALMIRALL SA           |
| 2182 | LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 2183 | LABRADOR IRON ORE ROYALTY TR             | 2184 | LADBROKES PLC                      |
| 2185 | LAFARGE CIMENTS/MOROCCO      | 2186 | LAFARGE MALAYAN CEMENT BERHAD            | 2187 | LAFARGE SA                         |
| 2188 | LAGARDERE S.C.A.             | 2189 | LAIRD GROUP PLC                          | 2190 | LAM RESEARCH CORP                  |
| 2191 | LAMAR ADVERTISING CO-CL A    | 2192 | LAN AIRLINES SA                          | 2193 | LAN AIRLINES SA-SPON ADR           |
| 2194 | LANCASTER COLONY CORP        | 2195 | LAND & HOUSES PUB CO LTD                 | 2196 | LAND SECURITIES GROUP PLC          |
| 2197 | LANDESBANK BERLIN HOLDING AG | 2198 | LANDSBANKI ISLANDS HF                    | 2199 | LANDSTAR SYSTEM INC                |
| 2200 | LANXESS                      | 2201 | LARSEN & TOUBRO LTD                      | 2202 | LAS VEGAS SANDS CORP               |
| 2203 | LASALLE HOTEL PROPERTIES     | 2204 | LASSILA & TIKANOJA OYJ                   | 2205 | LAWSON INC                         |
| 2206 | LAWSON SOFTWARE INC          | 2207 | LAZARD LTD-CL A                          | 2208 | LEAP WIRELESS INTL INC             |
| 2209 | LEAR CORP                    | 2210 | LEGAL & GENERAL GROUP PLC                | 2211 | LEGG MASON INC                     |
| 2212 | LEGGETT & PLATT INC          | 2213 | LEGRAND SA                               | 2214 | LEHMAN BROTHERS HOLDINGS INC       |
| 2215 | LEIGHTON HOLDINGS LIMITED    | 2216 | LEND LEASE CORP LIMITED                  | 2217 | LENNAR CORP-CL A                   |
| 2218 | LENNOX INTERNATIONAL INC     | 2219 | LENZING AG                               | 2220 | LEONI AG                           |
| 2221 | LEOPALACE21 CORP             | 2222 | LEUCADIA NATIONAL CORP                   | 2223 | LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC         |
| 2224 | LEXMARK INTERNATIONAL INC-A  | 2225 | LG CHEM LTD                              | 2226 | LG CORP                            |
| 2227 | LG DACOM CORP                | 2228 | LG ELECTRONICS INC                       | 2229 | LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE         |
| 2230 | LG LIFE SCIENCES LTD         | 2231 | LG.PHILIPS LCD CO LTD                    | 2232 | LG.PHILIPS LCD CO LTD-ADR          |
| 2233 | LI & FUNG LTD                | 2234 | LIBERTY GLOBAL INC                       | 2235 | LIBERTY INTERNATIONAL PLC          |
| 2236 | LIBERTY MEDIA CORP-CAP SER A | 2237 | LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A              | 2238 | LIBERTY PROPERTY TRUST             |
| 2239 | LIFE TIME FITNESS INC        | 2240 | LIFECELL CORPORATION                     | 2241 | LIFEPOINT HOSPITALS INC            |
| 2242 | LIG INSURANCE CO LTD         | 2243 | LIHIR GOLD LTD                           | 2244 | LIMITED BRANDS INC                 |
| 2245 | LINAMAR CORP                 | 2246 | LINCARE HOLDINGS INC                     | 2247 | LINCOLN ELECTRIC HOLDINGS          |
| 2248 | LINCOLN NATIONAL CORP        | 2249 | LINDAB INTERNATIONAL AB                  | 2250 | LINDE AG                           |
| 2251 | LINDT & SPRUENGLI AG-REG     | 2252 | LINEAR TECHNOLOGY CORP                   | 2253 | LINN ENERGY LLC-UNITS              |
| 2254 | LINTEC CORP                  | 2255 | LION CORP                                | 2256 | LION NATHAN LIMITED                |
| 2257 | LIONS GATE ENTERTAINMENT COR | 2258 | LIPPO KARAWACI TBK PT                    | 2259 | LIZ CLAIBORNE INC                  |
| 2260 | LKQ CORP                     | 2261 | LLOYDS TSB GROUP PLC                     | 2262 | LLOYDS TSB GROUP PLC -SP ADR       |
| 2263 | LOBLAW COMPANIES LTD         | 2264 | LOCALIZA RENT A CAR                      | 2265 | LOCKHEED MARTIN CORP               |
| 2266 | LOEWS CORP                   | 2267 | LOEWS CORP - CAROLINA GROUP              | 2268 | LOGICACMG PLC                      |
| 2269 | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 2270 | LOJAS AMERICANAS SA                      | 2271 | LOJAS RENNER SA                    |
| 2272 | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 2273 | LONGS DRUG STORES CORP                   | 2274 | LONMIN PLC                         |
| 2275 | LONZA GROUP AG-REG           | 2276 | L'OREAL                                  | 2277 | LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO         |
| 2278 | LOTTE CONFECTIONERY CO LTD   | 2279 | LOTTE SHOPPING CO                        | 2280 | LOTTOMATICA SPA                    |
| 2281 | LOUISIANA-PACIFIC CORP       | 2282 | LOWE'S COS INC                           | 2283 | LPP SA                             |
| 2284 | LS CABLE LTD                 | 2285 | LS INDUSTRIAL SYSTEMS                    | 2286 | LSI CORP                           |
| 2287 | LTD BRANDS INC               | 2288 | LUBRIZOL CORP                            | 2289 | LUKA KOPER                         |
| 2290 | LUKOIL                       | 2291 | LULULEMON ATHLETICA INC                  | 2292 | LUNDBERGFÖRETAGEN AB               |
| 2293 | LUNDIN MINING CORP           | 2294 | LUNDIN PETROLEUM AB                      | 2295 | LUPATECH SA                        |

| 項次   | 股票名稱                                   | 項次   | 股票名稱                                      | 項次   | 股票名稱                            |
|------|--|------|---|------|---------------------------------|
| 2296 | LUXOTTICA GROUP SPA                    | 2297 | LUXOTTICA GROUP SPA-SPON ADR              | 2298 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI    |
| 2299 | M & T BANK CORP                        | 2300 | M DIAS BRANCO SA                          | 2301 | M&T BANK                        |
| 2302 | M6-METROPOLE TELEVISION                | 2303 | MABANEE CO SAKC                           | 2304 | MABUCHI MOTOR CO LTD            |
| 2305 | MACARTHUR COAL LTD                     | 2306 | MACDONALD DETTWILER & ASSOC               | 2307 | MACERICH CO/THE                 |
| 2308 | MACK-CALI REALTY CORP                  | 2309 | MACQUARIE AIRPORTS                        | 2310 | MACQUARIE COMMUNICATIONS INF    |
| 2311 | MACQUARIE COUNTRYWIDE TRUST            | 2312 | MACQUARIE GROUP LTD                       | 2313 | MACQUARIE INFRASTRUCTURE CO LLC |
| 2314 | MACQUARIE INFRASTRUCTURE GRP           | 2315 | MACQUARIE KOREA INFRA FUND                | 2316 | MACQUARIE OFFICE TRUST          |
| 2317 | MACY'S INC                             | 2318 | MADRAS CEMENTS LTD                        | 2319 | MAGELLAN HEALTH SERVICES INC    |
| 2320 | MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A           | 2321 | MAGNESITA SA                              | 2322 | MAGNIT OAO                      |
| 2323 | MAGNITOGORSK IRON & STEEL WORKS        | 2324 | MAGNUM CORPORATION BHD                    | 2325 | MAGUIRE PROPERTIES INC          |
| 2326 | MAGYAR TELEKOM TELE-SPON ADR           | 2327 | MAHANAGAR TELEPHONE-ADR                   | 2328 | MAINOVA AG                      |
| 2329 | MAJOR DRILLING GROUP INTL              | 2330 | MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES LTD            | 2331 | MAKITA CORP                     |
| 2332 | MAKKAH CONSTRUCTION AND DEVELOPMENT CO | 2333 | MALAYAN BANKING BHD                       | 2334 | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD     |
| 2335 | MALAYSIAN AIRLINE SYSTEM BHD           | 2336 | MALAYSIAN BULK CARRIERS BHD               | 2337 | MAN AG                          |
| 2338 | MAN GROUP PLC                          | 2339 | MANDARIN ORIENTAL INTERNATIONAL LTD       | 2340 | MANITOBA TELECOM SVCS INC       |
| 2341 | MANITOU BF SA                          | 2342 | MANITOWOC COMPANY INC                     | 2343 | MANPOWER INC                    |
| 2344 | MANTECH INTERNATIONAL CORP-A           | 2345 | MANULIFE FINANCIAL CORP                   | 2346 | MAPFRE SA                       |
| 2347 | MAPLE LEAF FOODS INC                   | 2348 | MARATHON OIL CORP                         | 2349 | MARFIN INVESTMENT GROUP SA      |
| 2350 | MARFIN POPULAR BANK PUBLIC CO LTD      | 2351 | MARFRIG FRIGORIFICOS COMERCIO DE ALIMES E | 2352 | MARINE HARVEST                  |
| 2353 | MARINER ENERGY INC                     | 2354 | MARIUPOLSKY METAL-Y Z-D                   | 2355 | MARKEL CORP                     |
| 2356 | MARKS & SPENCER GROUP PLC              | 2357 | MAROC TELECOM                             | 2358 | MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A     |
| 2359 | MARSH & MCLENNAN COS                   | 2360 | MARSHALL & ILSLEY CORP                    | 2361 | MARTIN MARIETTA MATERIALS INC   |
| 2362 | MARTINSA-FADESA SA                     | 2363 | MARUBENI CORP                             | 2364 | MARUI GROUP CO LTD              |
| 2365 | MARUICHI STEEL TUBE LTD                | 2366 | MARVEL ENTERTAINMENT INC                  | 2367 | MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD    |
| 2368 | MASCO CORP                             | 2369 | MASIMO CORPORATION                        | 2370 | MASISA SA                       |
| 2371 | MASISA SA-ADR                          | 2372 | MASSEY ENERGY CO                          | 2373 | MASSMART HOLDINGS LTD           |
| 2374 | MASTERCARD INC-CLASS A                 | 2375 | MATSUI SECURITIES CO LTD                  | 2376 | MATSUMOTOKIYOSHI HOLDINGS CO    |
| 2377 | MATSUSHITA ELEC IND-SPON ADR           | 2378 | MATSUSHITA ELECTRIC INDUSTRIAL CO LTD     | 2379 | MATSUSHITA ELECTRIC WORKS LTD   |
| 2380 | MATSUYA CO LTD                         | 2381 | MATTEL INC                                | 2382 | MATTHEWS INTL CORP-CL A         |
| 2383 | MAX CAPITAL GROUP LTD                  | 2384 | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC             | 2385 | MAYR MELNHOF KARTON AG          |
| 2386 | MAZDA MOTOR CORP                       | 2387 | MB FINANCIAL INC                          | 2388 | MBIA INC                        |
| 2389 | MCAFFEE INC                            | 2390 | MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS               | 2391 | MCDERMOTT INTL INC              |
| 2392 | MCDONALD'S CORP                        | 2393 | MCDONALD'S HOLDINGS CO JAPAN LTD          | 2394 | MCGRAW-HILL COMPANIES INC       |
| 2395 | MCKESSON CORP                          | 2396 | MDC HOLDINGS INC                          | 2397 | MDS INC                         |
| 2398 | MDU RESOURCES GROUP INC                | 2399 | MEADWESTVACO CORP                         | 2400 | MECHEL                          |
| 2401 | MECHEL-ADR                             | 2402 | MEDA AB-A SHS                             | 2403 | MEDAREX INC                     |
| 2404 | MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC             | 2405 | MEDIASET SPA                              | 2406 | MEDICEO PALTAC HOLDING CO       |
| 2407 | MEDICIS PHARMACEUTICAL-CL A            | 2408 | MEDIOBANCA SPA                            | 2409 | MEDION AG                       |
| 2410 | MEDTRONIC INC                          | 2411 | MEGASTUDY CO LTD                          | 2412 | MEGAWORLD CORP                  |
| 2413 | MEGGITT PLC                            | 2414 | MEIJI DAIRIES CORP                        | 2415 | MEIJI SEIKA KAISHA LTD          |
| 2416 | MEINL EUROPEAN LAND LTD-CERT           | 2417 | MELCO ENTERTAINMENT-ADR PBL               | 2418 | MELKER SCHORLING AB             |
| 2419 | MEMC ELECTRONIC MATERIALS              | 2420 | MEN'S WEARHOUSE INC                       | 2421 | MENTOR CORP                     |
| 2422 | MERCADOLIBRE INC                       | 2423 | MERCATOR POSLOVNI SISTEM                  | 2424 | MERCIALYS SA                    |
| 2425 | MERCK & CO. INC.                       | 2426 | MERCK KGAA                                | 2427 | MERCURY GENERAL CORP            |
| 2428 | MEREDITH CORP                          | 2429 | MERIDIAN BIOSCIENCE INC                   | 2430 | MERITZ FIRE & MARINE INSURAN    |
| 2431 | MERRILL LYNCH & CO INC                 | 2432 | METAL MANAGEMENT INC                      | 2433 | METALL ZUG AG                   |
| 2434 | METALURGICA GERDAU SA                  | 2435 | METAVANTE TECHNOLOGIES INC                | 2436 | METCASH LTD                     |
| 2437 | METHANEX CORP                          | 2438 | METLIFE INC                               | 2439 | METRO AG                        |
| 2440 | METRO INC -A                           | 2441 | METROPCS COMMUNICATIONS INC               | 2442 | METROVACESA SA                  |
| 2443 | METSO OYJ                              | 2444 | METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL              | 2445 | MEXICHEM SAB DE CV              |
| 2446 | MF GLOBAL LTD                          | 2447 | MFA MORTGAGE INVESTMENTS INC              | 2448 | MGIC INVESTMENT CORP            |
| 2449 | MGM MIRAGE                             | 2450 | MI DEVELOPMENTS INC-CLASS A               | 2451 | MICHAEL PAGE INTERNATIONAL      |
| 2452 | MICHELIN (CGDE)-B                      | 2453 | MICROCHIP TECHNOLOGY INC                  | 2454 | MICRON TECHNOLOGY INC           |
| 2455 | MICROS SYSTEMS INC                     | 2456 | MICROSEMI CORP                            | 2457 | MICROSOFT CORP                  |

| 項次   | 股票名稱                              | 項次   | 股票名稱                                     | 項次   | 股票名稱                              |
|------|-----------------------------------|------|--|------|-----------------------------------|
| 2458 | MID-AMERICA APARTMENT COMM        | 2459 | MIDLAND CO                               | 2460 | MIGROS TURK TAS                   |
| 2461 | MIKHAYLOVSKIY GOK                 | 2462 | MILLEA HOLDINGS INC                      | 2463 | MILLENNIUM & COPTHORNE HOTELS PLC |
| 2464 | MILLENNIUM PHARMACEUTICALS        | 2465 | MILLICOM INTL CELLULAR S.A.              | 2466 | MILLIPORE CORP                    |
| 2467 | MINARA RESOURCES LTD              | 2468 | MINE SAFETY APPLIANCES CO                | 2469 | MINEBEA CO LTD                    |
| 2470 | MINERALS TECHNOLOGIES INC         | 2471 | MINOR INTERNATIONAL PCL                  | 2472 | MINSUR SA                         |
| 2473 | MIRACA HOLDINGS INC               | 2474 | MIRAE ASSET SECURITIES CO LT             | 2475 | MIRANT CORP                       |
| 2476 | MIRVAC GROUP                      | 2477 | MISC BHD                                 | 2478 | MISUMI GROUP INC                  |
| 2479 | MISYS PLC                         | 2480 | MITCHELLS & BUTLERS PLC                  | 2481 | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS      |
| 2482 | MITSUBISHI CORP                   | 2483 | MITSUBISHI ELECTRIC CORP                 | 2484 | MITSUBISHI ESTATE CO LTD          |
| 2485 | MITSUBISHI GAS CHEMICAL CO        | 2486 | MITSUBISHI HEAVY INDUSTRIES              | 2487 | MITSUBISHI LOGISTICS CORP         |
| 2488 | MITSUBISHI MATERIALS CORP         | 2489 | MITSUBISHI MOTORS CORP                   | 2490 | MITSUBISHI RAYON CO LTD           |
| 2491 | MITSUBISHI TANABE PHARMA          | 2492 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO             | 2493 | MITSUBISHI UFJ LEASE & FINAN      |
| 2494 | MITSUBISHI UFJ NICOS CO LTD       | 2495 | mitsui & CO LTD                          | 2496 | mitsui & CO LTD-SPONS ADR         |
| 2497 | mitsui CHEMICALS INC              | 2498 | mitsui ENGINEER & SHIPBUILD              | 2499 | mitsui FUDOSAN CO LTD             |
| 2500 | mitsui MINING & SMELTING CO       | 2501 | mitsui OSK LINES LTD                     | 2502 | mitsukoshi LTD                    |
| 2503 | mitsumi ELECTRIC CO LTD           | 2504 | MITTAL STEEL KRYVIY RIH                  | 2505 | MIXI INC                          |
| 2506 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC        | 2507 | MIZUHO FINANCIAL GROUP-ADR               | 2508 | MIZUHO INVESTORS SECS CO LTD      |
| 2509 | MIZUHO TRUST & BANKING CO         | 2510 | MKS INSTRUMENTS INC                      | 2511 | MMC CORP BHD                      |
| 2512 | MMC NORILSK NICKEL                | 2513 | MMX MINERACAO E METALICOS SA             | 2514 | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC  |
| 2515 | MOBILE TELESYSTEMS OJSC           | 2516 | MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR                | 2517 | MOBISTAR SA                       |
| 2518 | MOCHIDA PHARMACEUTICAL CO         | 2519 | MODERN TIMES GROUP-B SHS                 | 2520 | MOHAWK INDUSTRIES INC             |
| 2521 | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT    | 2522 | MOLEX INC -CL A                          | 2523 | MOLSON COORS BREWING CO -B        |
| 2524 | MONDI LTD                         | 2525 | MONDI PACKAGING PAPER SWIECIE SA         | 2526 | MONDI PLC                         |
| 2527 | MONEX BEANS HOLDINGS INC          | 2528 | MONSANTO COMPANY                         | 2529 | MONSTER WORLDWIDE INC             |
| 2530 | MONTPELIER RE HOLDINGS LTD        | 2531 | MOODY'S CORP                             | 2532 | MOOG INC-CLASS A                  |
| 2533 | MORGAN STANLEY                    | 2534 | MORI SEIKI CO LTD                        | 2535 | MORNINGSTAR INC                   |
| 2536 | MOSAIC CO/THE                     | 2537 | MOSENERGO TGK-3 OAO                      | 2538 | MOTA ENGLI SGPS SA                |
| 2539 | MOTOROLA INC                      | 2540 | MOUNT GIBSON IRON LTD                    | 2541 | MR PRICE GROUP LTD                |
| 2542 | M-REAL OYJ                        | 2543 | MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES SA          | 2544 | MSC INDUSTRIAL DIRECT CO-A        |
| 2545 | MSCI INC-A                        | 2546 | MTN GROUP LTD                            | 2547 | MTR CORP                          |
| 2548 | MTU AERO ENGINES HOLDING AG       | 2549 | MUELLER INDUSTRIES INC                   | 2550 | MUENCHENER RUECKVER AG-REG        |
| 2551 | MULLEN GROUP INCOME FUND          | 2552 | MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S | 2553 | MURATA MANUFACTURING CO LTD       |
| 2554 | MURCHISON METALS LTD              | 2555 | MURPHY OIL CORP                          | 2556 | MUSASHINO BANK LTD/THE            |
| 2557 | MYLAN INC                         | 2558 | MYRIAD GENETICS INC                      | 2559 | MYTILINEOS HOLDINGS SA            |
| 2560 | N BROWN GROUP PLC                 | 2561 | NABORS INDUSTRIES LTD                    | 2562 | NABTESCO CORP                     |
| 2563 | NAGARJUNA CONSTRUCTION CO         | 2564 | NAGASE & CO LTD                          | 2565 | NAGOYA RAILROAD CO LTD            |
| 2566 | NAL OIL & GAS TRUST-UTS           | 2567 | NALCO HOLDING CO                         | 2568 | NAMCO BANDAI HOLDINGS INC         |
| 2569 | NAMHAE CHEMICAL CORP              | 2570 | NAMPAK LTD                               | 2571 | NANTO BANK LTD/THE                |
| 2572 | NASDAQ STOCK MARKET INC           | 2573 | NASPERS LTD                              | 2574 | NATIONAL ALUMINIUM CO LTD         |
| 2575 | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD       | 2576 | NATIONAL BANK OF ABU DHABI               | 2577 | NATIONAL BANK OF CANADA           |
| 2578 | NATIONAL BANK OF GREECE           | 2579 | NATIONAL BANK OF GREECE -ADR             | 2580 | NATIONAL BANK OF KUWAIT           |
| 2581 | NATIONAL CITY CORP                | 2582 | NATIONAL EXPRESS GROUP PLC               | 2583 | NATIONAL FINANCIAL PARTNERS       |
| 2584 | NATIONAL FUEL GAS CO              | 2585 | NATIONAL GRID PLC                        | 2586 | NATIONAL GRID PLC-SP ADR          |
| 2587 | NATIONAL INDUSTRIES GROUP HOLDING | 2588 | NATIONAL INSTRUMENTS CORP                | 2589 | NATIONAL INVESTMENTS CO/KUWAIT    |
| 2590 | NATIONAL OILWELL VARCO INC        | 2591 | NATIONAL REAL ESTATE CO                  | 2592 | NATIONAL RETAIL PROPERTIES        |
| 2593 | NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP       | 2594 | NATIONWIDE FINANCIAL SERV- A             | 2595 | NATIONWIDE HEALTH PPTYS INC       |
| 2596 | NATIXIS                           | 2597 | NAVTEQ CORP                              | 2598 | NBTY INC                          |
| 2599 | NCC AB                            | 2600 | NCR CORPORATION                          | 2601 | NCSoft CORP                       |
| 2602 | NDS GROUP PLC-SPONS ADR           | 2603 | NEC CORP                                 | 2604 | NEC ELECTRONICS CORP              |
| 2605 | NEDBANK GROUP LTD                 | 2606 | NEOPOST SA                               | 2607 | NEPTUNE ORIENT LINES LTD          |
| 2608 | NESTLE OIL OYJ                    | 2609 | NESTLE INDIA LTD                         | 2610 | NESTLE MALAYSIA BHD               |
| 2611 | NESTLE SA-REG                     | 2612 | NET 1 UEPS TECHNOLOGIES INC              | 2613 | NET SERVICOS DE COM-PR ADR        |
| 2614 | NET SERVICOS DE COMUNICACAO SA    | 2615 | NETFLIX INC                              | 2616 | NETSUITE INC                      |
| 2617 | NETWORK APPLIANCE INC             | 2618 | NETWORK HEALTHCARE HOLDINGS LTD          | 2619 | NEUF CEGETEL                      |
| 2620 | NEUSTAR INC-CLASS A               | 2621 | NEW JERSEY RESOURCES CORP                | 2622 | NEW WORLD DEVELOPMENT             |
| 2623 | NEW YORK COMMUNITY BANCORP        | 2624 | NEW YORK TIMES CO -CL A                  | 2625 | NEWALLIANCE BANCSHARES INC        |
| 2626 | NEWCREST MINING LIMITED           | 2627 | NEWELL RUBBERMAID INC                    | 2628 | NEWFIELD EXPLORATION CO           |
| 2629 | NEWMONT MINING CORP               | 2630 | NEWMONT MINING CORP OF CANADA LTD        | 2631 | NEWS CORP.                        |
| 2632 | NEWS CORP-CDI CLASS B             | 2633 | NEWS CORP-CL A                           | 2634 | NEXANS SA                         |
| 2635 | NEXEN INC                         | 2636 | NEXITY                                   | 2637 | NEXT PLC                          |
| 2638 | NGK INSULATORS LTD                | 2639 | NGK SPARK PLUG CO LTD                    | 2640 | NH HOTELES SA                     |
| 2641 | NHK SPRING CO LTD                 | 2642 | NHN CORP                                 | 2643 | NICE SYSTEMS LTD-SPONS ADR        |
| 2644 | NICHIREI CORP                     | 2645 | NICOR INC                                | 2646 | NIDEC CORP                        |
| 2647 | NIDEC CORPORATION-ADR             | 2648 | NIDEC SANKYO CORP                        | 2649 | NIFCO INC/JAPAN                   |
| 2650 | NIHON UNISYS LTD                  | 2651 | NII HOLDINGS INC                         | 2652 | NIKANOR PLC                       |

| 項次   | 股票名稱                            | 項次   | 股票名稱                             | 項次   | 股票名稱                         |
|------|---------------------------------|------|----------------------------------|------|------------------------------|
| 2653 | NIKE INC -CL B                  | 2654 | NIKKO CORDIAL CORP               | 2655 | NIKO RESOURCES LTD           |
| 2656 | NIKON CORP                      | 2657 | NINTENDO CO LTD                  | 2658 | NIPPON ELECTRIC GLASS CO LTD |
| 2659 | NIPPON EXPRESS CO LTD           | 2660 | NIPPON MEAT PACKERS INC          | 2661 | NIPPON MINING HOLDINGS INC   |
| 2662 | NIPPON OIL CORP                 | 2663 | NIPPON PAPER GROUP INC           | 2664 | NIPPON SHEET GLASS CO LTD    |
| 2665 | NIPPON SHOKUBAI CO LTD          | 2666 | NIPPON STEEL CORP                | 2667 | NIPPON SUISAN KAISHA LTD     |
| 2668 | NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE    | 2669 | NIPPON TELEVISION NETWORK        | 2670 | NIPPON YUSEN                 |
| 2671 | NIPPONKOA INSURANCE CO LTD      | 2672 | NIPRO CORP                       | 2673 | NISHI-NIPPON CITY BANK LTD   |
| 2674 | NISHI-NIPPON RAILROAD CO LTD    | 2675 | NISOURCE INC                     | 2676 | NISSAN CHEMICAL INDUSTRIES   |
| 2677 | NISSAN MOTOR CO LTD             | 2678 | NISSAN MOTOR CO LTD-SPON ADR     | 2679 | NISSAN SHATAI CO LTD         |
| 2680 | NISSAY DOWA GENERAL INS         | 2681 | NISSHA PRINTING CO LTD           | 2682 | NISSHIN SEIFUN GROUP INC     |
| 2683 | NISSHIN STEEL CO LTD            | 2684 | NISSHINBO INDUSTRIES INC         | 2685 | NISSIN FOOD PRODUCTS CO LTD  |
| 2686 | NITORI CO LTD                   | 2687 | NITTO DENKO CORP                 | 2688 | NIZHNEKAMSKNEFTEKHIM         |
| 2689 | NKT HOLDING A/S                 | 2690 | NMDC LTD                         | 2691 | NOBEL BIOCARE HOLDING AG-BR  |
| 2692 | NOBIA AB                        | 2693 | NOBLE CORP                       | 2694 | NOBLE ENERGY INC             |
| 2695 | NOBLE GROUP LTD                 | 2696 | NOK CORP                         | 2697 | NOKIA CORP-SPON ADR          |
| 2698 | NOKIA OYJ                       | 2699 | NOKIAN RENKAAT OYJ               | 2700 | NOMURA HOLDINGS INC          |
| 2701 | NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS     | 2702 | NOMURA RESEARCH INSTITUTE        | 2703 | NONG SHIM CO LTD             |
| 2704 | NORDDEUTSCHE AFFINERIE AG       | 2705 | NORDEA BANK AB                   | 2706 | NORDEX AG                    |
| 2707 | NORDSON CORP                    | 2708 | NORDSTROM INC                    | 2709 | NORFOLK SOUTHERN CORP        |
| 2710 | NORSK HYDRO ASA                 | 2711 | NORTEL NETWORKS CORP             | 2712 | NORTHBRIDGE FINANCIAL CORP   |
| 2713 | NORTHEAST UTILITIES             | 2714 | NORTHERN TRUST CORP              | 2715 | NORTHROP GRUMMAN CORP        |
| 2716 | NORTHUMBRIAN WATER GROUP PLC    | 2717 | NORTHWEST AIRLINES CORP          | 2718 | NORTHWEST BANCORP INC        |
| 2719 | NORTHWEST NATURAL GAS CO        | 2720 | NORTHWESTERN CORP                | 2721 | NORWEGIAN PROPERTY ASA       |
| 2722 | NOVA CHEMICALS CORP             | 2723 | NOVAGOLD RESOURCES INC           | 2724 | NOVARTIS AG-REG              |
| 2725 | NOVATEK OAO                     | 2726 | NOVELL INC                       | 2727 | NOVELLUS SYSTEMS INC         |
| 2728 | NOVO NORDISK A/S-B              | 2729 | NOVOLIPETSK STEEL OJSC           | 2730 | NOVO-NORDISK A/S-SPONS ADR   |
| 2731 | NOVOROSCEMENT                   | 2732 | NOVOROSSIYSK COMMERCIAL SEA PORT | 2733 | NOVOZYMES A/S-B SHARES       |
| 2734 | NRG ENERGY INC                  | 2735 | NS SOLUTIONS CORP                | 2736 | NSK LTD                      |
| 2737 | NSTAR                           | 2738 | NTN CORP                         | 2739 | NTPC LTD                     |
| 2740 | NTT DATA CORP                   | 2741 | NTT DOCOMO INC                   | 2742 | NTT DOCOMO INC-SPON ADR      |
| 2743 | NTT URBAN DEVELOPMENT CORP      | 2744 | NU SKIN ENTERPRISES INC - A      | 2745 | NUANCE COMMUNICATIONS INC    |
| 2746 | NUCOR CORP                      | 2747 | NUFARM LTD                       | 2748 | NUH CIMENTO                  |
| 2749 | NUTRECO HOLDING NV              | 2750 | NUVASIVE INC                     | 2751 | NVIDIA CORP                  |
| 2752 | NVR INC                         | 2753 | NYMEX HOLDINGS INC               | 2754 | NYSE EURONEXT                |
| 2755 | OAO AEROFLOT                    | 2756 | OBAYASHI CORP                    | 2757 | OBIC BUSINESS CONSULTANTS    |
| 2758 | OBIC CO LTD                     | 2759 | OBRASCON HUARTE LAIN S.A.        | 2760 | OC OERLIKON CORP AG-REG      |
| 2761 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP       | 2762 | OCEANEERING INTL INC             | 2763 | ODAKYU ELECTRIC RAILWAY CO   |
| 2764 | ODFJELL SE                      | 2765 | ODYSSEY RE HOLDINGS CORP         | 2766 | OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A    |
| 2767 | OESTERREICHISCHE POST AG        | 2768 | OESTERREICHISCHE VOLKSBANKEN AG  | 2769 | OFFICE DEPOT INC             |
| 2770 | OFFICEMAX INC                   | 2771 | OGAKI KYORITSU BANK LTD/THE      | 2772 | OGE ENERGY CORP              |
| 2773 | OGK-2 OAO                       | 2774 | OGK-3 OJSC                       | 2775 | OGK-4 OJSC                   |
| 2776 | OGK-6 OAO                       | 2777 | OIL & NATURAL GAS CORP LTD       | 2778 | OIL SEARCH LTD               |
| 2779 | OIL STATES INTERNATIONAL INC    | 2780 | OILEXCO INCORPORATED             | 2781 | OJI PAPER CO LTD             |
| 2782 | OKASAN HOLDINGS INC             | 2783 | OKO BANK PLC-A                   | 2784 | OKUMA CORP                   |
| 2785 | OLAM INTERNATIONAL LTD          | 2786 | OLAV THON EINDOM A/S             | 2787 | OLD MUTUAL PLC               |
| 2788 | OLD NATL BANCORP/IN             | 2789 | OLD REPUBLIC INTL CORP           | 2790 | OLIN CORP                    |
| 2791 | OLYMPUS CORP                    | 2792 | OM GROUP INC                     | 2793 | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   |
| 2794 | OMNICARE INC                    | 2795 | OMNICOM GROUP                    | 2796 | OMNITURE INC                 |
| 2797 | OMRON CORP                      | 2798 | OMV AG                           | 2799 | OMX AB                       |
| 2800 | ON SEMICONDUCTOR CORPORATION    | 2801 | ONEBEACON INSURANCE GROUP LT     | 2802 | ONEOK INC                    |
| 2803 | ONESTEEL LIMITED                | 2804 | ONEX CORPORATION                 | 2805 | ONO PHARMACEUTICAL CO LTD    |
| 2806 | ONWARD HOLDINGS CO LTD          | 2807 | ONYX PHARMACEUTICALS INC         | 2808 | OPAP SA                      |
| 2809 | OPEN INVESTMENTS                | 2810 | OPEN TEXT CORP                   | 2811 | OPTI CANADA INC              |
| 2812 | OPTIONSXPRESS HOLDINGS INC      | 2813 | ORACLE CORP                      | 2814 | ORACLE CORP JAPAN            |
| 2815 | ORASCOM CONSTRUCTION INDUSTRIES | 2816 | ORASCOM HOTELS & DEVELOPMENT     | 2817 | ORASCOM TELECOM HOLDING SAE  |
| 2818 | ORBIS SA                        | 2819 | ORBITAL SCIENCES CORP            | 2820 | O'REILLY AUTOMOTIVE INC      |
| 2821 | ORESUND INVESTMENT AB           | 2822 | ORGANIZACION SORIANA SAB DE CV   | 2823 | ORICA LTD                    |
| 2824 | ORIENT EXPRESS HOTELS LTD -A    | 2825 | ORIENTAL LAND CO LTD             | 2826 | ORIENT-EXPRESS HOTELS LTD    |
| 2827 | ORIGIN ENERGY LIMITED           | 2828 | ORION CORP                       | 2829 | ORION OYJ                    |
| 2830 | ORIX - SPONSORED ADR            | 2831 | ORIX CORP                        | 2832 | ORKLA ASA                    |
| 2833 | ORMAT TECHNOLOGIES INC          | 2834 | ORPEA                            | 2835 | OSAKA GAS CO LTD             |
| 2836 | OSAKA TITANIUM TECHNOLOGIES     | 2837 | OSHKOSH TRUCK CORP               | 2838 | OSI PHARMACEUTICALS INC      |
| 2839 | OTP BANK NYRT                   | 2840 | OTSUKA CORP                      | 2841 | OUTOKUMPU OYJ                |
| 2842 | OUTOTEC OYJ                     | 2843 | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP     | 2844 | OVERSEAS SHIPHOLDING GROUP   |
| 2845 | OVERSEAS UNION ENTERPRISE LTD   | 2846 | OWENS & MINOR INC                | 2847 | OWENS CORNING INC            |
| 2848 | OWENS-ILLINOIS INC              | 2849 | OXIANA LTD                       | 2850 | P G & E CORP                 |
| 2851 | PACCAR INC                      | 2852 | PACIFIC BRANDS LTD               | 2853 | PACIFIC CORP                 |
| 2854 | PACIFIC METALS CO LTD           | 2855 | PACKAGING CORP OF AMERICA        | 2856 | PACTIV CORPORATION           |

| 項次   | 股票名稱                                     | 項次   | 股票名稱                                     | 項次   | 股票名稱                          |
|------|--|------|--|------|-------------------------------|
| 2857 | PADDY POWER PLC                          | 2858 | PAGESJAUNES GROUPE                       | 2859 | PALADIN ENERGY LIMITED        |
| 2860 | PALL CORP                                | 2861 | PAN AMERICAN SILVER CORP                 | 2862 | PAN AUSTRALIAN RESOURCES LTD  |
| 2863 | PANAHOME CORP                            | 2864 | PANALPINA WELTTRANSPORT-REG              | 2865 | PANERA BREAD COMPANY-CL A     |
| 2866 | PANTALOON RETAIL INDIA LTD               | 2867 | PARAMETRIC TECHNOLOGY CORP               | 2868 | PAREXEL INTERNATIONAL CORP    |
| 2869 | PARGESA HOLDING SA-BR                    | 2870 | PARK24 CO LTD                            | 2871 | PARKER HANNIFIN CORP          |
| 2872 | PARKWAY HOLDINGS LTD                     | 2873 | PARMALAT BRASIL INDUSTRIA DE ALIMENTOS S | 2874 | PARMALAT SPA                  |
| 2875 | PARQUESOL INMOBILIARIA SA                | 2876 | PARSVNATH DEVELOPERS LTD                 | 2877 | PARTNER COMMUNICATIONS-ADR    |
| 2878 | PARTNERRE LTD                            | 2879 | PARTNERS GROUP                           | 2880 | PARTYGAMING PLC               |
| 2881 | PATRIOT COAL CORP                        | 2882 | PATTERSON COS INC                        | 2883 | PATTERSON-UTI ENERGY INC      |
| 2884 | PAYCHEX INC                              | 2885 | PBG SA                                   | 2886 | PCCW LTD                      |
| 2887 | PDG REALTY SA EMPREENDIMENTOS E PARTICIP | 2888 | PDL BIOPHARMA INC                        | 2889 | PEAB AB                       |
| 2890 | PEABODY ENERGY CORP                      | 2891 | PEARSON PLC                              | 2892 | PEDIATRIX MEDICAL GROUP INC   |
| 2893 | PEMBINA PIPELINE INC-TR UTS              | 2894 | PENGROWTH ENERGY TRUST                   | 2895 | PENN NATIONAL GAMING INC      |
| 2896 | PENN VIRGINIA CORP                       | 2897 | PENN WEST ENERGY TRUST                   | 2898 | PENNON GROUP PLC              |
| 2899 | PENSKE AUTO GROUP INC                    | 2900 | PENTAIR INC                              | 2901 | PEOPLE'S UNITED FINANCIAL     |
| 2902 | PEPCO HOLDINGS INC                       | 2903 | PEPSI BOTTLING GROUP INC                 | 2904 | PEPSIAMERICAS INC             |
| 2905 | PEPSICO INC                              | 2906 | PERDIGAO SA                              | 2907 | PERFORMANCE FOOD GROUP CO     |
| 2908 | PERKINELMER INC                          | 2909 | PERNOD-RICARD SA                         | 2910 | PEROT SYSTEMS CORP-CL A       |
| 2911 | PERPETUAL LTD                            | 2912 | PERRIGO CO                               | 2913 | PERSIMMON PLC                 |
| 2914 | PERUSAHAAN GAS NEGARA PT                 | 2915 | PETKIM PETROKIMYA HOLDING                | 2916 | PETROBANK ENERGY & RESOURCES  |
| 2917 | PETROBRAS ENERGIA-SPON ADR               | 2918 | PETRO-CANADA                             | 2919 | PETROFAC LTD                  |
| 2920 | PETROHAWK ENERGY CORP                    | 2921 | PETROL OFISI                             | 2922 | PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR  |
| 2923 | PETROLEO BRASILEIRO SA                   | 2924 | PETROLEUM GEO-SERVICES                   | 2925 | PETRONAS DAGANGAN BHD         |
| 2926 | PETRONAS GAS BHD                         | 2927 | PETROPLUS HOLDINGS AG                    | 2928 | PETSMART INC                  |
| 2929 | PEUGEOT SA                               | 2930 | PEYTO ENERGY TRUST                       | 2931 | PFIZER INC                    |
| 2932 | PFLEIDERER AG                            | 2933 | PG&E CORP                                | 2934 | PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL  |
| 2935 | PHARMION CORP                            | 2936 | PHILADELPHIA CONS HLDG CO                | 2937 | PHILIPPINE LONG DIST -SP ADR  |
| 2938 | PHILIPS ELECTRONICS NV                   | 2939 | PHILIPS ELECTRONICS-NY SHR               | 2940 | PHILLIPS-VAN HEUSEN           |
| 2941 | PHOENIX COMPANIES INC                    | 2942 | PHOENIX MILLS LTD                        | 2943 | PIAGGIO & C SPA               |
| 2944 | PICK'N PAY STORES LTD                    | 2945 | PIEDMONT NATURAL GAS CO                  | 2946 | PIK GROUP                     |
| 2947 | PILGRIM'S PRIDE CORP                     | 2948 | PINFRA                                   | 2949 | PINNACLE ENTERTAINMENT INC    |
| 2950 | PINNACLE WEST CAPITAL                    | 2951 | PIONEER CORP                             | 2952 | PIONEER NATURAL RESOURCES CO  |
| 2953 | PIRAEUS BANK S.A.                        | 2954 | PIRELLI & C REAL ESTATE SPA              | 2955 | PIRELLI & C.                  |
| 2956 | PITNEY BOWES INC                         | 2957 | PLACOPLATRE SA                           | 2958 | PLAINS EXPLORATION & PRODUCT  |
| 2959 | PLATINUM ASSET MANGEMENT LTD             | 2960 | PLATINUM UNDERWRITERS HLDGS              | 2961 | PLAYTECH LTD                  |
| 2962 | PLAZA CENTERS NV                         | 2963 | PLEXUS CORP                              | 2964 | PLUM CREEK TIMBER CO          |
| 2965 | PLUS EXPRESSWAYS BHD                     | 2966 | PMC - SIERRA INC                         | 2967 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP  |
| 2968 | PNM RESOURCES INC                        | 2969 | PNOC ENERGY DEVELOPMENT CORP             | 2970 | POLARIS INDUSTRIES INC        |
| 2971 | POLIMEX MOSTOSTAL SA                     | 2972 | POLO RALPH LAUREN CORP                   | 2973 | POLYCOM INC                   |
| 2974 | POLYMETAL                                | 2975 | POLYUS GOLD CO                           | 2976 | POOL CORP                     |
| 2977 | POPULAR INC                              | 2978 | PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD               | 2979 | PORTLAND GENERAL ELECTRIC CO  |
| 2980 | PORTUCEL EMPRESA PRODUTORA DE PASTA E PA | 2981 | PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG             | 2982 | POSCO                         |
| 2983 | POSITIVO INFORMATICA SA                  | 2984 | POST PROPERTIES INC                      | 2985 | POTASH CORP OF SASKATCHEWAN   |
| 2986 | POTLATCH CORP                            | 2987 | POWER CORP OF CANADA                     | 2988 | POWER FINANCE CORP LTD        |
| 2989 | POWER FINANCIAL CORP                     | 2990 | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI | 2991 | POYRY OYJ                     |
| 2992 | PPB GROUP BERHAD                         | 2993 | PPG INDUSTRIES INC                       | 2994 | PPL CORPORATION               |
| 2995 | PPR                                      | 2996 | PRAKTIKER BAU-HEIMWERKERMAERKTE AG UND   | 2997 | PRAXAIR INC                   |
| 2998 | PRECISION CASTPARTS CORP                 | 2999 | PRECISION DRILLING TRUST                 | 3000 | PREMIER FOODS PLC             |
| 3001 | PRETORIA PORTLAND CEMENT CO LTD          | 3002 | PRICELINE.COM INC                        | 3003 | PRIDE INTERNATIONAL INC       |
| 3004 | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP                | 3005 | PRIVREDNA BANKA ZAGREB D.D.              | 3006 | PROASSURANCE CORP             |
| 3007 | PROCTER & GAMBLE CO                      | 3008 | PROGRESS ENERGY INC                      | 3009 | PROGRESS ENERGY TRUST         |
| 3010 | PROGRESS SOFTWARE CORP                   | 3011 | PROGRESSIVE CORP                         | 3012 | PROLOGIS                      |
| 3013 | PROMISE CO LTD                           | 3014 | PROMOTORA DE INFOM SA -PRISA             | 3015 | PROSAFE SE                    |
| 3016 | PROSEGUR SEGURIDAD-REGD COMP             | 3017 | PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD             | 3018 | PROSPERITY BANCSHARES INC     |
| 3019 | PROTECTIVE LIFE CORP                     | 3020 | PROVIDENT ENERGY TRUST-UTS               | 3021 | PROVIDENT FINANCIAL PLC       |
| 3022 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC                 | 3023 | PRUDENTIAL PLC                           | 3024 | PRYSMIAN SPA                  |
| 3025 | PSP SWISS PROPERTY AG-REG                | 3026 | PSS WORLD MEDICAL INC                    | 3027 | PSYCHIATRIC SOLUTIONS INC     |
| 3028 | PT ASTRA INTERNATIONAL TBK               | 3029 | PT INDOSAT-ADR                           | 3030 | PT MULTIMEDIA SERVICOS        |
| 3031 | PTT AROMATICS & REFINING PCL             | 3032 | PTT CHEMICAL PCL                         | 3033 | PTT EXPLOR & PROD PUBLIC CO   |
| 3034 | PTT PCL                                  | 3035 | PUBLIC BANK BHD                          | 3036 | PUBLIC POWER CORP             |
| 3037 | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP             | 3038 | PUBLIC STORAGE                           | 3039 | PUBLIC WAREHOUSING CO KSC/THE |
| 3040 | PUBLICIS GROUPE                          | 3041 | PUGET ENERGY INC                         | 3042 | PULTE HOMES INC               |

| 項次   | 股票名稱                         | 項次   | 股票名稱                           | 項次   | 股票名稱                               |
|------|------------------------------|------|--------------------------------|------|------------------------------------|
| 3043 | PUMA AG                      | 3044 | PUNCH TAVERNS PLC              | 3045 | PUNJ LLOYD LTD                     |
| 3046 | PUSAN BANK                   | 3047 | Q.P. CORP                      | 3048 | QANTAS AIRWAYS LTD                 |
| 3049 | QASSIM CEMENT                | 3050 | QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT | 3051 | QATAR NATIONAL BANK                |
| 3052 | QATAR NATIONAL CEMENT CO     | 3053 | QATAR SHIPPING CO              | 3054 | QBE INSURANCE GROUP LIMITED        |
| 3055 | Q-CELLS AG                   | 3056 | QIAGEN N.V.                    | 3057 | QIMONDA AG-SPONSORED ADR           |
| 3058 | QINETIQ PLC                  | 3059 | QLOGIC CORP                    | 3060 | QUALCOMM INC                       |
| 3061 | QUANEX CORP                  | 3062 | QUANTA SERVICES INC            | 3063 | QUEBECOR INC -CL B                 |
| 3064 | QUEENSLAND GAS COMPANY LTD   | 3065 | QUEST DIAGNOSTICS              | 3066 | QUEST SOFTWARE INC                 |
| 3067 | QUESTAR CORP                 | 3068 | QUICKSILVER RESOURCES INC      | 3069 | QUICKSILVER INC                    |
| 3070 | QUILMES INDUSTRIAL SA-ADR    | 3071 | QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR   | 3072 | QUINTAIN ESTATES & DEVELOPMENT PLC |
| 3073 | QWEST COMMUNICATIONS INTL    | 3074 | R.H. DONNELLEY CORP            | 3075 | RADIOSHACK CORP                    |
| 3076 | RAFFLES EDUCATION CORP LTD   | 3077 | RAIFFEISEN BANK AVAL           | 3078 | RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING       |
| 3079 | RAK PROPERTIES               | 3080 | RAKUTEN INC                    | 3081 | RALCORP HOLDINGS INC               |
| 3082 | RALLYE SA                    | 3083 | RAMBUS INC                     | 3084 | RAMIRENT OYJ                       |
| 3085 | RAMSAY HEALTH CARE LIMITED   | 3086 | RANDGOLD RESOURCES LTD-ADR     | 3087 | RANDON PARTICIPACOES SA            |
| 3088 | RANDSTAD HOLDING NV          | 3089 | RANGE RESOURCES CORP           | 3090 | RASPADSKAYA                        |
| 3091 | RATCHABURI ELEC GEN HODG PUB | 3092 | RATIONAL AG                    | 3093 | RATOS AB-B SHS                     |
| 3094 | RAUTARUUKKI OYJ              | 3095 | RAYMOND JAMES FINANCIAL INC    | 3096 | RAYONIER INC                       |
| 3097 | RAYTHEON COMPANY             | 3098 | RBC INFORMATION SYSTEMS        | 3099 | RCS MEDIAGROUP SPA                 |
| 3100 | REAL ESTATE / SAUDI ARABIA   | 3101 | REALIA BUSINESS SA             | 3102 | REALTY INCOME CORP                 |
| 3103 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 3104 | RED BACK MINING INC            | 3105 | RED ELECTRICA DE ESPANA            |
| 3106 | RED HAT INC                  | 3107 | REDECARD SA                    | 3108 | REDWOOD TRUST INC                  |
| 3109 | REECE AUSTRALIA LTD          | 3110 | REED ELSEVIER NV               | 3111 | REED ELSEVIER PLC                  |
| 3112 | REGAL BELOIT CORP            | 3113 | REGAL ENTERTAINMENT GROUP-A    | 3114 | REGAL-BELOIT CORP                  |
| 3115 | REGENCY CENTERS CORP         | 3116 | REGENCY ENERGY PARTNERS LP     | 3117 | REGENERON PHARMACEUTICALS          |
| 3118 | REGIONS FINANCIAL CORP       | 3119 | REGIS CORP                     | 3120 | REGUS GROUP PLC                    |
| 3121 | REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 3122 | REITMANS (CANADA) LTD -CL A    | 3123 | RELIANCE CAPITAL LTD               |
| 3124 | RELIANCE COMMUNICATIONS LTD  | 3125 | RELIANCE ENERGY LTD            | 3126 | RELIANCE INDUSTRIES LTD            |
| 3127 | RELIANCE STEEL & ALUMINUM    | 3128 | RELIANT ENERGY INC             | 3129 | RENAISSANCERE HOLDINGS LTD         |
| 3130 | RENAULT SA                   | 3131 | RENEWABLE ENERGY CORP AS       | 3132 | RENGO CO LTD                       |
| 3133 | RENTOKIL INITIAL PLC         | 3134 | REPOWER SYSTEMS AG             | 3135 | REPSOL YPF SA                      |
| 3136 | REPUBLIC SERVICES INC        | 3137 | RESEARCH IN MOTION             | 3138 | RESMED INC                         |
| 3139 | RESMED INC-CDI               | 3140 | RESOLUTION PLC                 | 3141 | RESONA HOLDINGS INC                |
| 3142 | RESORTS WORLD BHD            | 3143 | RESPIRONICS INC                | 3144 | REUNERT LTD                        |
| 3145 | REUTERS GROUP PLC            | 3146 | REXAM PLC                      | 3147 | REXEL SA                           |
| 3148 | REYAL URBIS SA               | 3149 | REYNOLDS AMERICAN INC          | 3150 | RGI INTERNATIONAL LTD              |
| 3151 | RH DONNELLEY CORP            | 3152 | RHB CAPITAL BHD                | 3153 | RHEINMETALL AG                     |
| 3154 | RHJ INTERNATIONAL            | 3155 | RHODIA SA - REGR               | 3156 | RHOEN-KLINIKUM AG                  |
| 3157 | RICHTER GEDEON NYRT          | 3158 | RICOH CO LTD                   | 3159 | RIETER HOLDING AG-REG              |
| 3160 | RIGHTMOVE PLC                | 3161 | RINNAI CORP                    | 3162 | RIO TINTO LTD                      |
| 3163 | RIO TINTO PLC                | 3164 | RIO TINTO PLC-SPON ADR         | 3165 | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR        |
| 3166 | RIOZIM LTD                   | 3167 | RIPLEY CORP SA                 | 3168 | RISANAMENTO SPA                    |
| 3169 | RISKMETRICS GROUP INC        | 3170 | RITCHIE BROS. AUCTIONEERS      | 3171 | RITE AID CORP                      |
| 3172 | RIVERBED TECHNOLOGY INC      | 3173 | RIVERSDALE MINING LTD          | 3174 | RIYAD BANK                         |
| 3175 | RLI CORP                     | 3176 | ROBBINS & MYERS INC            | 3177 | ROBERT HALF INTL INC               |
| 3178 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 3179 | ROCK-TENN COMPANY -CL A        | 3180 | ROCKWELL AUTOMATION INC            |
| 3181 | ROCKWELL COLLINS INC.        | 3182 | ROCKWOOD HOLDINGS INC          | 3183 | ROCKWOOL INTL A/S-B SHS            |
| 3184 | ROFIN-SINAR TECHNOLOGIES INC | 3185 | ROGERS COMMUNICATIONS -CL B    | 3186 | ROHM AND HAAS CO                   |
| 3187 | ROHM CO., LTD                | 3188 | ROHTO PHARMACEUTICAL CO LTD    | 3189 | ROLLINS INC                        |
| 3190 | ROLLS-ROYCE GROUP PLC        | 3191 | RONA INC                       | 3192 | ROPER INDUSTRIES INC               |
| 3193 | ROSNEFT OIL CO               | 3194 | ROSS STORES INC                | 3195 | ROSSI RESIDENCIAL SA               |
| 3196 | ROSTELECOM-SPONSORED ADR     | 3197 | ROTHMANS INC                   | 3198 | ROTORK PLC                         |
| 3199 | ROWAN COMPANIES INC          | 3200 | ROYAL & SUN ALLIANCE INS GRP   | 3201 | ROYAL BANK OF CANADA               |
| 3202 | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 3203 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD    | 3204 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS        |
| 3205 | ROYAL KPN NV                 | 3206 | RPC INC                        | 3207 | RPM INTERNATIONAL INC              |
| 3208 | RPS GROUP PLC                | 3209 | RR DONNELLEY & SONS CO         | 3210 | RSC HOLDINGS INC                   |
| 3211 | RTI INTERNATIONAL METALS INC | 3212 | RTL GROUP SA                   | 3213 | RUDDICK CORP                       |
| 3214 | RUSSEL METALS INC            | 3215 | RUUKKI GROUP OYJ               | 3216 | RWE AG                             |
| 3217 | RYANAIR HOLDINGS PLC         | 3218 | RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR    | 3219 | RYDER SYSTEM INC                   |
| 3220 | RYLAND GROUP INC             | 3221 | RYOHIN KEIKAKU CO LTD          | 3222 | S1 CORPORATION                     |
| 3223 | SA DES CEMENTS VICAT         | 3224 | SABMILLER PLC                  | 3225 | SACI FALABELLA                     |
| 3226 | SACYR VALLEHERMOSO SA        | 3227 | SADIA SA                       | 3228 | SAFCO                              |
| 3229 | SAFECO CORP                  | 3230 | SAFEWAY INC                    | 3231 | SAFRAN SA                          |
| 3232 | SAGAMI RAILWAY CO LTD        | 3233 | SAGE GROUP PLC (THE)           | 3234 | SAHARA PETROCHEMICAL CO            |
| 3235 | SAIC INC                     | 3236 | SAINSBURY (J) PLC              | 3237 | SAIPEM                             |
| 3238 | SAKS INC                     | 3239 | SALESFORCE.COM INC             | 3240 | SALLY BEAUTY HOLDINGS INC          |
| 3241 | SALZGITTER AG                | 3242 | SAMBA FINANCIAL GROUP          | 3243 | SAMPO OYJ-A SHS                    |
| 3244 | SAMSUNG CARD CO              | 3245 | SAMSUNG CORPORATION            | 3246 | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD   |

| 項次   | 股票名稱                          | 項次   | 股票名稱                                    | 項次   | 股票名稱                                     |
|------|-------------------------------|------|---|------|--|
| 3247 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD    | 3248 | SAMSUNG ENGINEERING CO LTD              | 3249 | SAMSUNG FINE CHEMICALS CO                |
| 3250 | SAMSUNG FIRE & MARINE INS     | 3251 | SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES                | 3252 | SAMSUNG SDI CO LTD                       |
| 3253 | SAMSUNG SECURITIES CO LTD     | 3254 | SAMSUNG TECHWIN CO LTD                  | 3255 | SAN MIGUEL CORP                          |
| 3256 | SANDISK CORP                  | 3257 | SANDRIDGE ENERGY INC                    | 3258 | SANDVIK AB                               |
| 3259 | SAN-IN GODO BANK LTD/THE      | 3260 | SANKYO CO LTD                           | 3261 | SANKYU INC                               |
| 3262 | SANLAM LTD                    | 3263 | SANOFI-AVENTIS                          | 3264 | SANOMAWSOY OYJ                           |
| 3265 | SANTEN PHARMACEUTICAL CO LTD  | 3266 | SANTOS LTD                              | 3267 | SANWA HOLDINGS CORP                      |
| 3268 | SANYO ELECTRIC CO LTD         | 3269 | SAO PAULO ALPARGATAS SA                 | 3270 | SAP AG                                   |
| 3271 | SAPPI LTD                     | 3272 | SAPPI LTD -SPONSORED ADR                | 3273 | SAPPORO HOKUYO HOLDINGS INC              |
| 3274 | SAPPORO HOLDINGS LTD          | 3275 | SAPUTO INC                              | 3276 | SARA LEE CORP                            |
| 3277 | SAS AB                        | 3278 | SASKATCHEWAN WHEAT POOL                 | 3279 | SASOL LTD                                |
| 3280 | SASOL LTD-SPONSORED ADR       | 3281 | SATYAM COMPUTER SERVICES LTD            | 3282 | SATYAM COMPUTER SERVICES-ADR             |
| 3283 | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP   | 3284 | SAUDI BRITISH BANK                      | 3285 | SAUDI CEMENT                             |
| 3286 | SAUDI ELECTRICITY CO          | 3287 | SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP       | 3288 | SAUDI INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO     |
| 3289 | SAUDI INVESTMENT BANK         | 3290 | SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO            | 3291 | SAUDI TELECOM CO                         |
| 3292 | SAVA                          | 3293 | SAVIENT PHARMACEUTICALS INC             | 3294 | SAVOLA                                   |
| 3295 | SAVVIS INC                    | 3296 | SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A            | 3297 | SBERBANK                                 |
| 3298 | SBI E*TRADE SECURITIES CO LTD | 3299 | SBI HOLDINGS INC                        | 3300 | SBM OFFSHORE NV                          |
| 3301 | SCA HYGIENE PRODUCTS AG       | 3302 | SCANIA AB-B SHS                         | 3303 | SCHERING-PLOUGH CORP                     |
| 3304 | SCHIBSTED ASA                 | 3305 | SCHINDLER HOLDING-PART CERT             | 3306 | SCHLUMBERGER LTD                         |
| 3307 | SCHNEIDER ELECTRIC SA         | 3308 | SCHNITZER STEEL INDS INC-A              | 3309 | SCHOLASTIC CORP                          |
| 3310 | SCHRODERS PLC                 | 3311 | SCHULTHESS GROUP                        | 3312 | SCHWAB (CHARLES) CORP                    |
| 3313 | SCHWARZ PHARMA AG             | 3314 | SCIENTIFIC GAMES CORP-A                 | 3315 | SCOR SE                                  |
| 3316 | SCOTTISH & NEWCASTLE PLC      | 3317 | SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY              | 3318 | SCOTTS MIRACLE-GRO CO-CL A               |
| 3319 | SEABOARD CORP                 | 3320 | SEACOR HOLDINGS INC                     | 3321 | SEADRILL LTD                             |
| 3322 | SEAGATE TECHNOLOGY            | 3323 | SEALED AIR CORP                         | 3324 | SEARS CANADA INC                         |
| 3325 | SEARS HOLDINGS CORP           | 3326 | SEASPAN CORP                            | 3327 | SEAT PAGINE GIALLE                       |
| 3328 | SEB SA                        | 3329 | SECHE ENVIRONNEMENT SA                  | 3330 | SECHILLENNE-SIDEC                        |
| 3331 | SECO TOOLS                    | 3332 | SECOM CO LTD                            | 3333 | SECURITAS AB-B SHS                       |
| 3334 | SECURITAS DIRECT AB           | 3335 | SECURITIES HOUSE                        | 3336 | SEEK LTD                                 |
| 3337 | SEGA SAMMY HOLDINGS INC       | 3338 | SEGO PLC                                | 3339 | SEI INVESTMENTS COMPANY                  |
| 3340 | SEIKO EPSON CORP              | 3341 | SEINO HOLDINGS CO LTD                   | 3342 | SEKISUI CHEMICAL CO LTD                  |
| 3343 | SEKISUI HOUSE LTD             | 3344 | SELECTIVE INSURANCE GROUP               | 3345 | SEMAPA-SOCIEDADE DE INVESTIMENTO E GESTA |
| 3346 | SEMBCORP INDUSTRIES LTD       | 3347 | SEMBCORP MARINE LTD                     | 3348 | SEMEN GRESIK PERSERO TBK PT              |
| 3349 | SEMPRA ENERGY                 | 3350 | SENIOR HOUSING PROP TRUST               | 3351 | SENSIENT TECHNOLOGIES CORP               |
| 3352 | SEOUL BROADCASTING SYSTEM     | 3353 | SEPRACOR INC                            | 3354 | SERCO GROUP PLC                          |
| 3355 | SERVICE CORP INTERNATIONAL    | 3356 | SES-FDR                                 | 3357 | SEVEN & I HOLDINGS CO LTD                |
| 3358 | SEVEN NETWORK LIMITED         | 3359 | SEVENTH CONTINENT                       | 3360 | SEVERN TRENT PLC                         |
| 3361 | SEVERSTAL                     | 3362 | SFCG CO LTD                             | 3363 | SGL CARBON AG                            |
| 3364 | SGS SA-REG                    | 3365 | SHARP CORP                              | 3366 | SHAW COMMUNICATIONS INC-B                |
| 3367 | SHAW GROUP INC                | 3368 | SHAWCOR LTD                             | 3369 | SHELL REFINING CO (F.O.M.)               |
| 3370 | SHERRITT INTERNATIONAL CORP   | 3371 | SHERWIN-WILLIAMS CO/THE                 | 3372 | SHIGA BANK LTD/THE                       |
| 3373 | SHIKOKU ELECTRIC POWER CO     | 3374 | SHIMA SEIKI MFG LTD                     | 3375 | SHIMACHU CO LTD                          |
| 3376 | SHIMADZU CORP                 | 3377 | SHIMAMURA CO LTD                        | 3378 | SHIMANO INC                              |
| 3379 | SHIMIZU CORP                  | 3380 | SHIN CORP PCL                           | 3381 | SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD                |
| 3382 | SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD   | 3383 | SHINKO ELECTRIC INDUSTRIES              | 3384 | SHINKO SECURITIES CO LTD                 |
| 3385 | SHINSEGAE CO LTD              | 3386 | SHINSEI BANK LTD                        | 3387 | SHIONOGI & CO LTD                        |
| 3388 | SHIP FINANCE INTL LTD         | 3389 | SHIRE PLC                               | 3390 | SHISEIDO CO LTD                          |
| 3391 | SHIZUOKA BANK LTD/THE         | 3392 | SHOPPERS DRUG MART CORP                 | 3393 | SHOWA DENKO K K                          |
| 3394 | SHOWA SHELL SEKIYU KK         | 3395 | SIA ENGINEERING CO LTD                  | 3396 | SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD                |
| 3397 | SIAM CITY CEMENT PUB CO LTD   | 3398 | SIAM COMMERCIAL BANK PUB CO             | 3399 | SIBIRSKIY CEMENT                         |
| 3400 | SIDI KERIR PETROCHEMICALS CO  | 3401 | SIEMENS AG-REG                          | 3402 | SIEMENS INDIA LTD                        |
| 3403 | SIERRA HEALTH SERVICES INC    | 3404 | SIERRA PACIFIC RESOURCES                | 3405 | SIG PLC                                  |
| 3406 | SIGMA DESIGNS INC             | 3407 | SIGMA PHARMACEUTICALS LTD               | 3408 | SIGMA-ALDRICH                            |
| 3409 | SIGNET GROUP PLC              | 3410 | SIKA AG-BR                              | 3411 | SILGAN HOLDINGS INC                      |
| 3412 | SILIC                         | 3413 | SILICON LABORATORIES INC                | 3414 | SILOVIYE MASHINY                         |
| 3415 | SILVER STANDARD RESOURCES     | 3416 | SILVER WHEATON CORP                     | 3417 | SILVERCORP METALS INC                    |
| 3418 | SILVINIT                      | 3419 | SIME DARBY BERHAD                       | 3420 | SIMON PROPERTY GROUP INC                 |
| 3421 | SIMPSON MANUFACTURING CO INC  | 3422 | SIMS GROUP LTD                          | 3423 | SINA CORP                                |
| 3424 | SINGAPORE AIRLINES LTD        | 3425 | SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD | 3426 | SINGAPORE EXCHANGE LTD                   |
| 3427 | SINGAPORE LAND LTD            | 3428 | SINGAPORE POST LTD                      | 3429 | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD             |
| 3430 | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG    | 3431 | SINGAPORE TELECOMM-CDI                  | 3432 | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD         |
| 3433 | SINO GOLD MINING LTD          | 3434 | SINO LAND CO                            | 3435 | SINO-FOREST CORPORATION                  |
| 3436 | SIRIUS SATELLITE RADIO INC    | 3437 | SIRONA DENTAL SYSTEMS INC               | 3438 | SISTEMA JSFC                             |
| 3439 | SISTEMA-HALS                  | 3440 | SK CHEMICALS CO LTD                     | 3441 | SK ENERGY CO LTD                         |
| 3442 | SK HOLDINGS CO LTD            | 3443 | SK NETWORKS CO LTD                      | 3444 | SK SECURITIES CO LTD                     |
| 3445 | SK TELECOM                    | 3446 | SKANDINAVISKA ENSKILDA                  | 3447 | SKANSKA AB-B SHS                         |

| 項次   | 股票名稱                                    | 項次   | 股票名稱                                     | 項次   | 股票名稱                                     |
|------|---|------|--|------|--|
|      |   |      | BAN-A                                    |      |  |
| 3448 | SKF AB-B SHARES                         | 3449 | SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP LTD         | 3450 | SKY PERFECT JSAT CORP                    |
| 3451 | SKYWEST INC                             | 3452 | SKYWORKS SOLUTIONS INC                   | 3453 | SL GREEN REALTY CORP                     |
| 3454 | SLIGRO FOOD GROUP NV                    | 3455 | SLM CORP                                 | 3456 | SM INVESTMENTS CORP                      |
| 3457 | SM PRIME HOLDINGS INC                   | 3458 | SMC CORP                                 | 3459 | SMITH & NEPHEW PLC                       |
| 3460 | SMITH (A.O.) CORP                       | 3461 | SMITH INTERNATIONAL INC                  | 3462 | SMITHFIELD FOODS INC                     |
| 3463 | SMITHS GROUP PLC                        | 3464 | SMRT CORP LTD                            | 3465 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC                  |
| 3466 | SMURFIT-STONE CONTAINER CORP            | 3467 | SNAM RETE GAS                            | 3468 | SNAP-ON INC                              |
| 3469 | SNC-LAVALIN GROUP INC                   | 3470 | SOBHA DEVELOPERS LTD                     | 3471 | SOCIEDAD GENERAL DE AGUAS DE BARCELONA S |
| 3472 | SOCIEDAD MINERA CERRO VERDE SA          | 3473 | SOCIETA INIZIATIVE AUTOSTRADALI E SERVIZ | 3474 | SOCIETE BIC SA                           |
| 3475 | SOCIETE DES AUTOROUTES PARIS-RHIN-RHONE | 3476 | SOCIETE DES BAINS DE MER ET DU CERCLE DE | 3477 | SOCIETE FONCIERE FINANCIERE ET DE PARTIC |
| 3478 | SOCIETE FONCIERE LYONNAISE SA           | 3479 | SOCIETE GENERALE                         | 3480 | SOCIETE TELEVISION FRANCAISE I           |
| 3481 | SODEXHO ALLIANCE SA                     | 3482 | SOFTBANK CORP                            | 3483 | SOFTWARE AG                              |
| 3484 | SOGECABLE                               | 3485 | SOHGO SECURITY SERVICES CO               | 3486 | S-OIL CORPORATION                        |
| 3487 | SOJITZ CORP                             | 3488 | SOL MELIA SA                             | 3489 | SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBI             |
| 3490 | SOLARWORLD AG                           | 3491 | SOLERA HOLDINGS INC                      | 3492 | SOLIDERE                                 |
| 3493 | SOLVAY SA                               | 3494 | SOMFY SA                                 | 3495 | SOMPO JAPAN INSURANCE INC                |
| 3496 | SONAE SGPS SA                           | 3497 | SONGBIRD ESTATES PLC                     | 3498 | SONIC AUTOMOTIVE INC-CLASS A             |
| 3499 | SONIC CORP                              | 3500 | SONIC HEALTHCARE LTD                     | 3501 | SONOCO PRODUCTS CO                       |
| 3502 | SONOVA HOLDING AG-REG                   | 3503 | SONY CORP                                | 3504 | SONY FINANCIAL HOLDINGS INC              |
| 3505 | SOROUH REAL ESTATE CO                   | 3506 | SOS CUETARA SA                           | 3507 | SOTHEBY'S                                |
| 3508 | SOUTH FINANCIAL GROUP INC               | 3509 | SOUTH JERSEY INDUSTRIES                  | 3510 | SOUTH ORE MINING & PROCESSING FRANCHISE  |
| 3511 | SOUTHERN CO                             | 3512 | SOUTHERN COPPER CORP                     | 3513 | SOUTHERN COPPER CORP/PERU                |
| 3514 | SOUTHERN CROSS HEALTHCARE LTD           | 3515 | SOUTHERN PROVINCE CEMENT CO              | 3516 | SOUTHERN UNION CO                        |
| 3517 | SOUTHWEST AIRLINES CO                   | 3518 | SOUTHWEST GAS CORP                       | 3519 | SOUTHWESTERN ENERGY CO                   |
| 3520 | SOUZA CRUZ SA                           | 3521 | SOVEREIGN BANCORP INC                    | 3522 | SP AUSNET                                |
| 3523 | SP SETIA BHD                            | 3524 | SPARK INFRASTRUCTURE GROUP               | 3525 | SPECTRA ENERGY CORP                      |
| 3526 | SPECTRIS PLC                            | 3527 | SPEEDWAY MOTORSPORTS INC                 | 3528 | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC             |
| 3529 | SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A            | 3530 | SPONDA OYJ                               | 3531 | SPORTS DIRECT INTERNATIONAL PLC          |
| 3532 | SPRINT NEXTEL CORP                      | 3533 | SPX CORP                                 | 3534 | SQUARE ENIX CO LTD                       |
| 3535 | SRA INTERNATIONAL INC-CL A              | 3536 | SSAB SVENSKT STAL AB                     | 3537 | SSANGYONG CEMENT IND                     |
| 3538 | ST GEORGE BANK LIMITED                  | 3539 | ST JOE CO/THE                            | 3540 | ST JUDE MEDICAL INC                      |
| 3541 | ST MARY LAND & EXPLORATION              | 3542 | ST MODWEN PROPERTIES PLC                 | 3543 | STADA ARZNEIMITTEL AG                    |
| 3544 | STAGECOACH GROUP PLC                    | 3545 | STANCORP FINANCIAL GROUP                 | 3546 | STANDARD BANK GROUP LTD                  |
| 3547 | STANDARD CHARTERED PLC                  | 3548 | STANDARD LIFE PLC                        | 3549 | STANLEY ELECTRIC CO LTD                  |
| 3550 | STANLEY WORKS/THE                       | 3551 | STANTEC INC                              | 3552 | STAPLES INC                              |
| 3553 | STARBUCKS CORP                          | 3554 | STARHUB LTD                              | 3555 | STARWOOD HOTELS & RESORTS                |
| 3556 | STATE AUTO FINANCIAL CORP               | 3557 | STATE STREET CORP                        | 3558 | STATOILHYDRO ASA                         |
| 3559 | STATS CHIPPAC LTD                       | 3560 | STEEL AUTHORITY OF INDIA LTD             | 3561 | STEEL DYNAMICS INC                       |
| 3562 | STEELCASE INC-CL A                      | 3563 | STEINHOF INTERNATIONAL HOLDINGS LTD      | 3564 | STERICYCLE INC                           |
| 3565 | STERIS CORP                             | 3566 | STERLITE INDUSTRIES INDIA LTD            | 3567 | STERLITE INDUSTRIES INDI-ADR             |
| 3568 | STMICROELECTRONICS NV                   | 3569 | STOCKLAND                                | 3570 | STOCKMANN OYJ ABP                        |
| 3571 | STOLT-NIELSEN SA                        | 3572 | STONE ENERGY CORP                        | 3573 | STORA ENSO OYJ-R SHS                     |
| 3574 | STOREBRAND ASA                          | 3575 | STORK NV                                 | 3576 | STRABAG AG                               |
| 3577 | STRAITS RESOURCES LIMITED               | 3578 | STRAITS TRADING CO LTD                   | 3579 | STRATEGIC HOTELS & RESORTS I             |
| 3580 | STRAUMANN HOLDING AG                    | 3581 | STRAUMUR-BURDARAS FJARFESTINGABANKI HF   | 3582 | STRAYER EDUCATION INC                    |
| 3583 | STRYKER CORP                            | 3584 | STUDENT LOAN CORP                        | 3585 | STX CORPORATION                          |
| 3586 | STX ENGINE CO LTD                       | 3587 | STX PAN OCEAN CO LTD                     | 3588 | STX SHIPBUILDING CO LTD                  |
| 3589 | SUBSEA 7 INC                            | 3590 | SUED-CHEMIE AG                           | 3591 | SUEDZUCKER AG                            |
| 3592 | SUEZ CEMENT                             | 3593 | SUEZ SA                                  | 3594 | SUGI PHARMACY CO LTD                     |
| 3595 | SULZER AG-REG                           | 3596 | SUMCO CORP                               | 3597 | SUMITOMO BAKELITE CO LTD                 |
| 3598 | SUMITOMO CHEMICAL CO LTD                | 3599 | SUMITOMO CORP                            | 3600 | SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES             |
| 3601 | SUMITOMO FORESTRY CO LTD                | 3602 | SUMITOMO HEAVY INDUSTRIES                | 3603 | SUMITOMO METAL INDUSTRIES                |
| 3604 | SUMITOMO METAL MINING CO LTD            | 3605 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR             | 3606 | SUMITOMO REAL ESTATE SALES               |
| 3607 | SUMITOMO REALTY & DEVELOPMNT            | 3608 | SUMITOMO RUBBER INDUSTRIES               | 3609 | SUMITOMO TRUST & BANKING CO              |
| 3610 | SUN HUNG KAI PROPERTIES                 | 3611 | SUN INTERBREW UKRAINE                    | 3612 | SUN INTERNATIONAL LTD                    |
| 3613 | SUN LIFE FINANCIAL INC                  | 3614 | SUN MICROSYSTEMS INC                     | 3615 | SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD        |
| 3616 | SUN TV NETWORK LTD                      | 3617 | SUNCOM WIRELESS HOLDING-CL A             | 3618 | SUNCOR ENERGY INC                        |
| 3619 | SUNCORP-METWAY LTD                      | 3620 | SUNDRUG CO LTD                           | 3621 | SUNOCO INC                               |
| 3622 | SUNPOWER CORP-CLASS A                   | 3623 | SUNRISE SENIOR LIVING INC                | 3624 | SUNTRUST BANKS INC                       |
| 3625 | SUPERIOR ENERGY SERVICES INC            | 3626 | SUPERVALU INC                            | 3627 | SURAMERICANA DE INVERSIONES SA           |
| 3628 | SURGUTNEFTEGAZ                          | 3629 | SURUGA BANK LTD                          | 3630 | SUSQUEHANNA BANCSHARES INC               |

| 項次   | 股票名稱                               | 項次   | 股票名稱                              | 項次   | 股票名稱                         |
|------|------------------------------------|------|-----------------------------------|------|------------------------------|
| 3631 | SUZLON ENERGY LTD                  | 3632 | SUZUKEN CO LTD                    | 3633 | SUZUKI MOTOR CORP            |
| 3634 | SVB FINANCIAL GROUP                | 3635 | SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS        | 3636 | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  |
| 3637 | SWATCH GROUP AG                    | 3638 | SWEDBANK AB - A SHARES            | 3639 | SWEDISH MATCH AB             |
| 3640 | SWIFT ENERGY CO                    | 3641 | SWIRE PACIFIC LTD 'A'             | 3642 | SWISS LIFE HOLDING-REG       |
| 3643 | SWISS PRIME SITE AG                | 3644 | SWISS RE-REG                      | 3645 | SWISSCOM AG-REG              |
| 3646 | SYBASE INC                         | 3647 | SYDBANK A/S                       | 3648 | SYMANTEC CORP                |
| 3649 | SYMBION HEALTH LTD                 | 3650 | SYMRISE AG                        | 3651 | SYNEAR FOOD HOLDINGS LTD     |
| 3652 | SYNGENTA AG-REG                    | 3653 | SYNIVERSE HOLDINGS INC            | 3654 | SYNOPSIS INC                 |
| 3655 | SYNOVUS FINANCIAL CORP             | 3656 | SYNTEL INC                        | 3657 | SYNTHES INC                  |
| 3658 | SYNUTRA INTERNATIONAL INC          | 3659 | SYSCO CORP                        | 3660 | SYSTEMX CORP                 |
| 3661 | T ROWE PRICE GROUP INC             | 3662 | T&D HOLDINGS INC                  | 3663 | TABCORP HOLDINGS LIMITED     |
| 3664 | TADANO LTD                         | 3665 | TAEKWANG INDUSTRIAL CO LTD        | 3666 | TAEWOONG CO LTD              |
| 3667 | TAIBAH                             | 3668 | TAIHAN ELECTRIC WIRE CO LTD       | 3669 | TAIHEIYO CEMENT CORP         |
| 3670 | TAISEI CORP                        | 3671 | TAISHO PHARMACEUTICAL CO LTD      | 3672 | TAIYO NIPPON SANSO CORP      |
| 3673 | TAIYO YUDEN CO LTD                 | 3674 | TAKARA HOLDINGS INC               | 3675 | TAKASHIMAYA CO LTD           |
| 3676 | TAKATA CORP                        | 3677 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD      | 3678 | TAKEFUJI CORP                |
| 3679 | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE      | 3680 | TAKKT AG                          | 3681 | TALISMAN ENERGY INC          |
| 3682 | TAM SA-SPONSORED ADR               | 3683 | TANDBERG ASA                      | 3684 | TANGER FACTORY OUTLET CENTER |
| 3685 | TANJONG PLC                        | 3686 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP       | 3687 | TARGET CORP                  |
| 3688 | TATA CHEMICALS LTD                 | 3689 | TATA CONSULTANCY SERVICES LTD     | 3690 | TATA MOTORS LTD-SPON ADR     |
| 3691 | TATA STEEL LTD                     | 3692 | TATE & LYLE PLC                   | 3693 | TATTS GROUP LTD              |
| 3694 | TAUBMAN CENTERS INC                | 3695 | TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS      | 3696 | TAYLOR NELSON SOFRES PLC     |
| 3697 | TAYLOR WIMPEY PLC                  | 3698 | TC PIPELINES LP                   | 3699 | TCF FINANCIAL CORP           |
| 3700 | TD AMERITRADE HOLDING CORP         | 3701 | TDC A/S                           | 3702 | TDK CORP                     |
| 3703 | TDK CORP-SPONSORED ADR             | 3704 | TECH DATA CORP                    | 3705 | TECH MAHINDRA LTD            |
| 3706 | TECHEM AG                          | 3707 | TECHNE CORP                       | 3708 | TECHNIP SA                   |
| 3709 | TECK COMINCO LTD                   | 3710 | TECK COMINCO LTD-CL B             | 3711 | TECNICAS REUNIDAS SA         |
| 3712 | TECO ENERGY INC                    | 3713 | TEEKAY CORP                       | 3714 | TEIJIN LTD                   |
| 3715 | TELE ATLAS NV                      | 3716 | TELE NORTE LESTE PARTICIPACOES SA | 3717 | TELE2 AB-B SHS               |
| 3718 | TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR        | 3719 | TELECOM CORP OF NEW ZEALAND       | 3720 | TELECOM ITALIA SPA           |
| 3721 | TELECOM NEW ZEALAND-SP ADR         | 3722 | TELECOMUNICACOES DE SAO PAULO SA  | 3723 | TELEDYNE TECHNOLOGIES INC    |
| 3724 | TELEFLEX INC                       | 3725 | TELEFONAKTIEBOLAGET ERICSSON LM   | 3726 | TELEFONICA DE ARGEN-SPON ADR |
| 3727 | TELEFONICA O2 CZECH REPUBLIC AS    | 3728 | TELEFONICA SA                     | 3729 | TELEFONOS DE MEXICO-SP ADR L |
| 3730 | TELEKOM AUSTRIA AG                 | 3731 | TELEKOM MALAYSIA BHD              | 3732 | TELEKOMUNIK INDONESIA-SP ADR |
| 3733 | TELEKOMUNIKACJA POLSKA SA          | 3734 | TELEKOMUNIKASI INDONESIA TBK PT   | 3735 | TELEMAR NORTE LESTE SA       |
| 3736 | TELENOR ASA                        | 3737 | TELEPERFORMANCE                   | 3738 | TELEPHONE AND DATA SYSTEMS   |
| 3739 | TELETECH HOLDINGS INC              | 3740 | TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)      | 3741 | TELIASONERA AB               |
| 3742 | TELKOM SA LTD                      | 3743 | TELKOM SOUTH AFRICA-SPON ADR      | 3744 | TELLABS INC                  |
| 3745 | TELSTRA CORP LTD                   | 3746 | TELSTRA CORPORATION-INS RECP      | 3747 | TELUS CORP                   |
| 3748 | TEMPLE-INLAND INC                  | 3749 | TEMPUR-PEDIC INTERNATIONAL        | 3750 | TEN NETWORK HOLDINGS LIMITED |
| 3751 | TENAGA NASIONAL BHD                | 3752 | TENARIS SA                        | 3753 | TENARIS SA-ADR               |
| 3754 | TENET HEALTHCARE CORP              | 3755 | TENNECO INC                       | 3756 | TERADATA CORP                |
| 3757 | TERADYNE INC                       | 3758 | TERANET INCOME FUND               | 3759 | TEREX CORP                   |
| 3760 | TERNA SPA                          | 3761 | TERNIUM SA-SPONSORED ADR          | 3762 | TERRA INDUSTRIES INC         |
| 3763 | TERUMO CORP                        | 3764 | TESCO PLC                         | 3765 | TESORO CORP                  |
| 3766 | TESSENDERLO CHEMIE NV              | 3767 | TESSERA TECHNOLOGIES INC          | 3768 | TETRA TECH INC               |
| 3769 | TETRA TECHNOLOGIES INC             | 3770 | TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR        | 3771 | TEXAS INDUSTRIES INC         |
| 3772 | TEXAS INSTRUMENTS INC              | 3773 | TEXTRON INC                       | 3774 | TFS FINANCIAL CORP           |
| 3775 | TGS NOPEC GEOPHYSICAL CO ASA       | 3776 | THAI AIRWAYS INTERNATIONAL        | 3777 | THAI BEVERAGE PCL            |
| 3778 | THAI OIL PCL                       | 3779 | THALES SA                         | 3780 | THE BUCKLE INC               |
| 3781 | THE COOPER COS INC                 | 3782 | THE MEN'S WEARHOUSE INC           | 3783 | THE MOSAIC COMPANY           |
| 3784 | THE SEIYU LTD                      | 3785 | THE ST JOE COMPANY                | 3786 | THE SWATCH GROUP AG-BR       |
| 3787 | THE WALT DISNEY CO                 | 3788 | THERAVANCE INC                    | 3789 | THERMAX LTD                  |
| 3790 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC       | 3791 | THK CO LTD                        | 3792 | THOMAS & BETTS CORP          |
| 3793 | THOMAS COOK GROUP PLC              | 3794 | THOMPSON CREEK METALS CO INC      | 3795 | THOMSON (EX-TMM)             |
| 3796 | THOMSON CORP                       | 3797 | THOR INDUSTRIES INC               | 3798 | THORNBURG MORTGAGE INC       |
| 3799 | THQ INC                            | 3800 | THYSSENKRUPP AG                   | 3801 | TIBCO SOFTWARE INC           |
| 3802 | TIDEWATER INC                      | 3803 | TIFFANY & CO                      | 3804 | TIGER BRANDS LTD             |
| 3805 | TIM HORTONS INC                    | 3806 | TIM PARTICIPACOES SA              | 3807 | TIME WARNER CABLE-A          |
| 3808 | TIME WARNER INC                    | 3809 | TIME WARNER TELECOM-CLASS A       | 3810 | TIMKEN CO                    |
| 3811 | TINGYI CAYMAN ISLANDS HOLDING CORP | 3812 | TITAN CEMENT CO. S.A.             | 3813 | TITANIUM METALS CORP         |
| 3814 | TJX COMPANIES INC                  | 3815 | TMB BANK PCL                      | 3816 | TMK OAO                      |
| 3817 | TNK-BP HOLDING                     | 3818 | TNT NV                            | 3819 | TOBU RAILWAY CO LTD          |

| 項次   | 股票名稱                                   | 項次   | 股票名稱                              | 項次   | 股票名稱                                |
|------|--|------|-----------------------------------|------|-------------------------------------|
| 3820 | TOC CO LTD                             | 3821 | TODA CORP                         | 3822 | TOD'S SPA                           |
| 3823 | TOGNUM AG                              | 3824 | TOHO CO LTD                       | 3825 | TOHO GAS CO LTD                     |
| 3826 | TOHO PHARMACEUTICAL CO LTD             | 3827 | TOHO TITANIUM CO LTD              | 3828 | TOHOKU ELECTRIC POWER CO INC        |
| 3829 | TOKAI CARBON CO LTD                    | 3830 | TOKAI RIKA CO LTD                 | 3831 | TOKAI RUBBER INDUSTRIES             |
| 3832 | TOKAI TOKYO SECURITIES CO              | 3833 | TOKUYAMA CORPORATION              | 3834 | TOKYO BROADCASTING SYSTEM           |
| 3835 | TOKYO DOME CORP                        | 3836 | TOKYO ELECTRIC POWER CO INC       | 3837 | TOKYO ELECTRIC POWER CO INC/THE     |
| 3838 | TOKYO ELECTRON LTD                     | 3839 | TOKYO GAS CO LTD                  | 3840 | TOKYO STAR BANK LTD/THE             |
| 3841 | TOKYO STEEL MFG CO LTD                 | 3842 | TOKYO TATEMONO CO LTD             | 3843 | TOKYU CORP                          |
| 3844 | TOKYU LAND CORP                        | 3845 | TOLL BROTHERS INC                 | 3846 | TOLL HOLDINGS LIMITED               |
| 3847 | TOMKINS PLC                            | 3848 | TOMTOM                            | 3849 | TONENGENERAL SEKIYU KK              |
| 3850 | TONG YANG INVESTMENT BANK              | 3851 | TOOTSIE ROLL INDS                 | 3852 | TOPDANMARK A/S                      |
| 3853 | TOPPAN FORMS CO LTD                    | 3854 | TOPPAN PRINTING CO LTD            | 3855 | TORAY INDUSTRIES INC                |
| 3856 | TORCHMARK CORP                         | 3857 | TORO CO                           | 3858 | TOROMONT INDUSTRIES LTD             |
| 3859 | TORONTO-DOMINION BANK                  | 3860 | TORSTAR CORP - CL B               | 3861 | TOSHIBA CORP                        |
| 3862 | TOSHIBA MACHINE CO LTD                 | 3863 | TOSHIBA TEC CORP                  | 3864 | TOSOH CORP                          |
| 3865 | TOTAL ACCESS COMMUNICATION             | 3866 | TOTAL SA                          | 3867 | TOTAL SYSTEM SERVICES INC           |
| 3868 | TOTO LTD                               | 3869 | TOYAMA CHEMICAL CO LTD            | 3870 | TOYO INK MFG CO LTD                 |
| 3871 | TOYO SEIKAN KAISHA LTD                 | 3872 | TOYO SUISAN KAISHA LTD            | 3873 | TOYO TANSO CO LTD                   |
| 3874 | TOYOBO CO LTD                          | 3875 | TOYODA GOSEI CO LTD               | 3876 | TOYOTA AUTO BODY CO LTD             |
| 3877 | TOYOTA BOSHOKU CORP                    | 3878 | TOYOTA INDUSTRIES CORP            | 3879 | TOYOTA MOTOR CORP                   |
| 3880 | TOYOTA MOTOR CORP -SPON ADR            | 3881 | TOYOTA TSUSHO CORP                | 3882 | TRACTEBEL ENERGIA SA                |
| 3883 | TRACTOR SUPPLY COMPANY                 | 3884 | TRADUS PLC                        | 3885 | TRANE INC                           |
| 3886 | TRANSALTA CORP                         | 3887 | TRANSATLANTIC HOLDINGS INC        | 3888 | TRANSCANADA CORP                    |
| 3889 | TRANSCONTINENTAL INC-CL A              | 3890 | TRANSDIGM GROUP INC               | 3891 | TRANSFIELD SERVICES LIMITED         |
| 3892 | TRANSOCEAN INC                         | 3893 | TRANSPACIFIC INDUSTRIES GROU      | 3894 | TRANSURBAN GROUP                    |
| 3895 | TRAVELERS COS INC/THE                  | 3896 | TRAVIS PERKINS PLC                | 3897 | TRELLEBORG AB-B SHS                 |
| 3898 | TREND MICRO INC                        | 3899 | TRICAN WELL SERVICE LTD           | 3900 | TRIMBLE NAVIGATION LTD              |
| 3901 | TRINITY INDUSTRIES INC                 | 3902 | TRINITY MIRROR PLC                | 3903 | TRUBA ALAM MANUNGGAL ENGINEERING PT |
| 3904 | TRUSTMARK CORP                         | 3905 | TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD       | 3906 | TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP        |
| 3907 | TS TECH CO LTD                         | 3908 | TSAKOS ENERGY NAVIGATION LTD      | 3909 | TSUBAKIMOTO CHAIN CO                |
| 3910 | TSUMURA & CO                           | 3911 | TSX GROUP INC                     | 3912 | TUBACEX SA                          |
| 3913 | TUBOS REUNIDOS SA                      | 3914 | TUI AG                            | 3915 | TUI TRAVEL PLC                      |
| 3916 | TULLOW OIL PLC                         | 3917 | TUPPERWARE BRANDS CORP            | 3918 | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS     |
| 3919 | TURKCELL ILETISIM HIZMET-ADR           | 3920 | TURKIYE GARANTI BANKASI AS        | 3921 | TURKIYE HALK BANKASI AS             |
| 3922 | TURKIYE IS BANKASI                     | 3923 | TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO      | 3924 | TV ASAHI CORP                       |
| 3925 | TYCO ELECTRONICS LTD                   | 3926 | TYCO INTERNATIONAL LTD            | 3927 | TYSON FOODS INC-CL A                |
| 3928 | UAL CORP                               | 3929 | UAP HOLDING CORP                  | 3930 | UBE INDUSTRIES LTD                  |
| 3931 | UBISOFT ENTERTAINMENT                  | 3932 | UBS AG-REG                        | 3933 | UCB SA                              |
| 3934 | UCBH HOLDINGS INC                      | 3935 | UDR INC                           | 3936 | UEM WORLD BHD                       |
| 3937 | UGI CORP                               | 3938 | ULTRA ELECTRONICS HOLDINGS        | 3939 | ULTRA PETROLEUM CORP                |
| 3940 | ULTRA TECH CEMENT LTD                  | 3941 | ULVAC INC                         | 3942 | UMB FINANCIAL CORP                  |
| 3943 | UMICORE                                | 3944 | UMW HOLDINGS BHD                  | 3945 | UNDER ARMOUR INC-CLASS A            |
| 3946 | UNIBAIL-RODAMCO                        | 3947 | UNIBANCO                          | 3948 | UNICHARM CORP                       |
| 3949 | UNICREDIT SPA                          | 3950 | UNIFIED ENERGY SYSTEM-CLS         | 3951 | UNILEVER INDONESIA TBK PT           |
| 3952 | UNILEVER NV-CVA                        | 3953 | UNILEVER PLC                      | 3954 | UNION FENOSA SA                     |
| 3955 | UNION PACIFIC CORP                     | 3956 | UNION PROPERTIES                  | 3957 | UNIONBANCAL CORPORATION             |
| 3958 | UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC           | 3959 | UNIPOL GRUPPO FINANZIARI-PFD      | 3960 | UNISOURCE ENERGY CORP CO            |
| 3961 | UNISYS CORP                            | 3962 | UNIT CORP                         | 3963 | UNITECH LTD                         |
| 3964 | UNITED BANKSHARES INC                  | 3965 | UNITED BUSINESS MEDIA PLC         | 3966 | UNITED GROUP LTD                    |
| 3967 | UNITED INDUSTRIAL CORP LTD             | 3968 | UNITED INTERNET AG                | 3969 | UNITED NATURAL FOODS INC            |
| 3970 | UNITED OVERSEAS BANK LTD               | 3971 | UNITED PARCEL SERVICE-CL B        | 3972 | UNITED PHOSPHORUS LTD               |
| 3973 | UNITED RENTALS INC                     | 3974 | UNITED STATES STEEL CORP          | 3975 | UNITED STATIONERS INC               |
| 3976 | UNITED TECHNOLOGIES CORP               | 3977 | UNITED THERAPEUTICS CORP          | 3978 | UNITED TRACTORS TBK PT              |
| 3979 | UNITED UTILITIES PLC                   | 3980 | UNITEDHEALTH GROUP INC            | 3981 | UNITRIN INC                         |
| 3982 | UNITY BANK PLC                         | 3983 | UNIVERSAL AMERICAN CORP           | 3984 | UNIVERSAL CORP/VA                   |
| 3985 | UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B            | 3986 | UNUM GROUP                        | 3987 | UNY CO LTD                          |
| 3988 | UOL GROUP LTD                          | 3989 | UPM-KYMMENE OYJ                   | 3990 | URALITA SA                          |
| 3991 | URALKALI                               | 3992 | URANIUM ONE INC                   | 3993 | URBAN CORP                          |
| 3994 | URBAN OUTFITTERS INC                   | 3995 | URBI DESARROLLOS URBANOS SA DE CV | 3996 | URS CORP                            |
| 3997 | US AIRWAYS GROUP INC                   | 3998 | US BANCORP                        | 3999 | US CELLULAR CORP                    |
| 4000 | USG CORP                               | 4001 | USG PEOPLE NV                     | 4002 | USHIO INC                           |
| 4003 | USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS SA | 4004 | USJ CO LTD                        | 4005 | USS CO LTD                          |
| 4006 | UST INC                                | 4007 | UTI WORLDWIDE INC                 | 4008 | UTS ENERGY CORP                     |
| 4009 | VAIL RESORTS INC                       | 4010 | VALAD PROPERTY GROUP              | 4011 | VALEANT PHARMACEUTICALS INTE        |
| 4012 | VALEO SA                               | 4013 | VALERO ENERGY CORP                | 4014 | VALHI INC                           |
| 4015 | VALIDUS HOLDINGS LTD                   | 4016 | VALLEY NATIONAL BANCORP           | 4017 | VALLOUREC                           |

| 項次   | 股票名稱                         | 項次   | 股票名稱                            | 項次   | 股票名稱                             |
|------|------------------------------|------|---------------------------------|------|----------------------------------|
| 4018 | VALMONT INDUSTRIES           | 4019 | VALSPAR CORP                    | 4020 | VALUECLICK INC                   |
| 4021 | VARIAN INC                   | 4022 | VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC      | 4023 | VARIAN SEMICONDUCTOR EQUIP       |
| 4024 | VATTENFALL EUROPE AG         | 4025 | VCA ANTECH INC                  | 4026 | VECTOR GROUP LTD                 |
| 4027 | VECTREN CORPORATION          | 4028 | VEDANTA RESOURCES PLC           | 4029 | VEDIOR NV-CVA                    |
| 4030 | VEIDEKKE ASA                 | 4031 | VENTANA MEDICAL SYSTEMS         | 4032 | VENTAS INC                       |
| 4033 | VENTURE CORP LTD             | 4034 | VEOLIA ENVIRONNEMENT            | 4035 | VERBUND                          |
| 4036 | VERIFONE HOLDINGS INC        | 4037 | VERIGY LTD                      | 4038 | VERISIGN INC                     |
| 4039 | VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 4040 | VERMILION ENERGY TRUST          | 4041 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC       |
| 4042 | VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 4043 | VF CORP                         | 4044 | VIACOM INC-CL B                  |
| 4045 | VIACOM INC-CLASS B           | 4046 | VIDEOCON INDUSTRIES LTD         | 4047 | VIDESH SANCHAR NIGAM-ADR         |
| 4048 | VIETNAM DAIRY PRODUCT CO     | 4049 | VIMPELCOM-SP ADR                | 4050 | VINA CONCHA Y TORO SA-SP ADR     |
| 4051 | VINCI SA                     | 4052 | VIRGIN BLUE HOLDINGS LTD        | 4053 | VIRGIN MEDIA INC                 |
| 4054 | VISHAY INTERTECHNOLOGY INC   | 4055 | VISTAPRINT LTD                  | 4056 | VIVARTIA SA                      |
| 4057 | VIVENDI                      | 4058 | VIVO PARTICIPACOES SA           | 4059 | VMWARE INC-CLASS A               |
| 4060 | VOCENTO SA                   | 4061 | VODAFONE GROUP PLC              | 4062 | VOESTALPINE AG                   |
| 4063 | VOLCAN CIA MINERA SAA        | 4064 | VOLGA TERRITORIAL GENERATING CO | 4065 | VOLKSWAGEN AG                    |
| 4066 | VOLTAS LTD                   | 4067 | VOLVO AB-B SHS                  | 4068 | VORNADO REALTY TRUST             |
| 4069 | VOSSLOH AG                   | 4070 | VOTORANTIM CELULOSE-SPON ADR    | 4071 | VSMPO-AVISMA CORP                |
| 4072 | VTB BANK OJSC                | 4073 | VULCAN MATERIALS CO             | 4074 | VYKSA METALLURGICAL              |
| 4075 | W&T OFFSHORE INC             | 4076 | WABCO HOLDINGS INC              | 4077 | WABTEC CORP                      |
| 4078 | WACHOVIA CORP                | 4079 | WACKER CHEMIE AG                | 4080 | WACOAL HOLDINGS CORP             |
| 4081 | WADDELL & REED FINANCIAL-A   | 4082 | WALGREEN CO                     | 4083 | WALLENSTAM BYGGNADS AB           |
| 4084 | WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV | 4085 | WAL-MART STORES INC             | 4086 | WALT DISNEY CO.                  |
| 4087 | WALTER INDUSTRIES INC        | 4088 | WAREHOUSE GROUP LTD             | 4089 | WARNACO GROUP INC/THE            |
| 4090 | WARNER CHILCOTT LTD-CLASS A  | 4091 | WARTSILA OYJ-B SHARES           | 4092 | WASHINGTON FEDERAL INC           |
| 4093 | WASHINGTON MUTUAL INC        | 4094 | WASHINGTON POST -CL B           | 4095 | WASHINGTON REAL ESTATE INV       |
| 4096 | WASTE CONNECTIONS INC        | 4097 | WASTE MANAGEMENT INC            | 4098 | WATERS CORP                      |
| 4099 | WATSON PHARMACEUTICALS INC   | 4100 | WATSON WYATT WORLDWIDE INC-A    | 4101 | WATTS WATER TECHNOLOGIES-A       |
| 4102 | WEATHERFORD INTL LTD         | 4103 | WEBMD HEALTH CORP-CLASS A       | 4104 | WEBSTER FINANCIAL CORP           |
| 4105 | WEG SA                       | 4106 | WEIGHT WATCHERS INTL INC        | 4107 | WEINGARTEN REALTY INVESTORS      |
| 4108 | WEIR GROUP PLC (THE)         | 4109 | WELLCARE HEALTH PLANS INC       | 4110 | WELLPOINT INC                    |
| 4111 | WELLS FARGO & COMPANY        | 4112 | WELSPUN-GUJARAT STAHL LTD       | 4113 | WENDEL                           |
| 4114 | WENDY'S INTERNATIONAL INC    | 4115 | WERELDHAVE NV                   | 4116 | WERNER ENTERPRISES INC           |
| 4117 | WESCO INTERNATIONAL INC      | 4118 | WESFARMERS LIMITED              | 4119 | WEST AFRICAN PORTLAND CEMENT PLC |
| 4120 | WEST AUSTRALIAN NEWSPAPERS   | 4121 | WEST FRASER TIMBER CO LTD       | 4122 | WEST JAPAN RAILWAY CO            |
| 4123 | WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 4124 | WESTAMERICA BANCORPORATION      | 4125 | WESTAR ENERGY INC                |
| 4126 | WESTERN DIGITAL CORP         | 4127 | WESTERN REFINING INC            | 4128 | WESTERN UNION CO                 |
| 4129 | WESTFIELD GROUP              | 4130 | WESTJET AIRLINES LTD            | 4131 | WESTLAKE CHEMICAL CORP           |
| 4132 | WESTON (GEORGE) LTD          | 4133 | WESTPAC BANKING CORP            | 4134 | WESTPAC BANKING CORP-SP ADR      |
| 4135 | WESTSHORE TERMINALS INC FD   | 4136 | WEYERHAEUSER CO                 | 4137 | WGL HOLDINGS INC                 |
| 4138 | W-H ENERGY SERVICES INC      | 4139 | WH SMITH PLC                    | 4140 | WHARF HOLDINGS LTD               |
| 4141 | WHEELLOCK & CO LTD           | 4142 | WHEELLOCK PROPERTIES S LTD      | 4143 | WHIRLPOOL CORP                   |
| 4144 | WHIRLPOOL SA                 | 4145 | WHITBREAD PLC                   | 4146 | WHITE MOUNTAINS INSURANCE GP     |
| 4147 | WHITING PETROLEUM CORP       | 4148 | WHITNEY HOLDING CORP            | 4149 | WHOLE FOODS MARKET INC           |
| 4150 | WIENERBERGER AG              | 4151 | WILEY (JOHN) & SONS -CL A       | 4152 | WILH WILHELMSSEN ASA             |
| 4153 | WILLBROS GROUP INC           | 4154 | WILLIAM DEMANT HOLDING          | 4155 | WILLIAM HILL PLC                 |
| 4156 | WILLIAMS COS INC             | 4157 | WILLIAMS-SONOMA INC             | 4158 | WILLIS GROUP HOLDINGS LTD        |
| 4159 | WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 4160 | WILMINGTON TRUST CORP           | 4161 | WIMM-BILL-DANN FOODS-ADR         |
| 4162 | WINCOR NIXDORF AG            | 4163 | WINDSTREAM CORP                 | 4164 | WING TAI HOLDINGS LTD            |
| 4165 | WIPRO LTD-ADR                | 4166 | WIRECARD AG                     | 4167 | WISCONSIN ENERGY CORP            |
| 4168 | WM MORRISON SUPERMARKETS     | 4169 | WM WRIGLEY JR CO                | 4170 | WMS INDUSTRIES INC               |
| 4171 | WOLSELEY PLC                 | 4172 | WOLTERS KLUWER                  | 4173 | WOLVERINE WORLD WIDE INC         |
| 4174 | WOOD GROUP (JOHN) PLC        | 4175 | WOODSIDE PETROLEUM LTD          | 4176 | WOODWARD GOVERNOR CO             |
| 4177 | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD      | 4178 | WOOLWORTHS LIMITED              | 4179 | WOONGJIN COWAY CO LTD            |
| 4180 | WOORI FINANCE HOLDINGS CO    | 4181 | WOORI INVESTMENT & SECURITIE    | 4182 | WORLD WRESTLING ENTMTNT INC-A    |
| 4183 | WORLEYPARSONS LTD            | 4184 | WORTHINGTON INDUSTRIES          | 4185 | WPP GROUP PLC                    |
| 4186 | WR BERKLEY CORP              | 4187 | WR GRACE & CO                   | 4188 | WRIGHT EXPRESS CORP              |
| 4189 | WRIGLEY WM JR CO             | 4190 | WW GRAINGER INC                 | 4191 | WYETH                            |
| 4192 | WYNDHAM WORLDWIDE CORP       | 4193 | WYNN RESORTS LTD                | 4194 | XCEL ENERGY INC                  |
| 4195 | XCHANGING PLC                | 4196 | XEBIO CO LTD                    | 4197 | XENOPORT INC                     |
| 4198 | XEROX CORP                   | 4199 | XILINX INC                      | 4200 | XL CAPITAL LTD -CLASS A          |
| 4201 | XM SATELLITE RADIO HOLD-CL A | 4202 | XSTRATA PLC                     | 4203 | XTO ENERGY INC                   |
| 4204 | YAHOO! INC                   | 4205 | YAHOO! JAPAN CORP               | 4206 | YAKULT HONSHA CO LTD             |
| 4207 | YAMADA DENKI CO LTD          | 4208 | YAMAGUCHI FINANCIAL GROUP IN    | 4209 | YAMAHA CORP                      |
| 4210 | YAMAHA MOTOR CO LTD          | 4211 | YAMAMAH SAUDI CEMENT CO         | 4212 | YAMANA GOLD INC                  |
| 4213 | YAMANASHI CHUO BANK LTD/THE  | 4214 | YAMATAKE CORP                   | 4215 | YAMATO HOLDINGS CO LTD           |
| 4216 | YAMATO KOGYO CO LTD          | 4217 | YAMAZAKI BAKING CO LTD          | 4218 | YANBU CEMENT                     |

| 項次   | 股票名稱                                     | 項次   | 股票名稱                         | 項次   | 股票名稱                         |
|------|--|------|------------------------------|------|------------------------------|
| 4219 | YANBU NATIONAL PETROCHEMICALS CO         | 4220 | YANGZIJANG SHIPBUILDING      | 4221 | YANLORD LAND GROUP LTD       |
| 4222 | YAPI VE KREDI BANKASI AS                 | 4223 | YARA INTERNATIONAL ASA       | 4224 | YASKAWA ELECTRIC CORP        |
| 4225 | YELL GROUP PLC                           | 4226 | YELLOW PAGES INCOME FUND     | 4227 | YIT OYJ                      |
| 4228 | YOKOGAWA ELECTRIC CORP                   | 4229 | YOKOHAMA RUBBER CO LTD       | 4230 | YOSHINOYA HOLDINGS CO LTD    |
| 4231 | YPF S.A.-SPONSORED ADR                   | 4232 | YTL CORPORATION BERHAD       | 4233 | YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS |
| 4234 | YUHAN CORPORATION                        | 4235 | YUM! BRANDS INC              | 4236 | ZAGREBACKA BANKA DD          |
| 4237 | ZAKLAD PRZETWORSTWA HUTNICZEGO STALPRODU | 4238 | ZARDOYA OTIS SA              | 4239 | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A |
| 4240 | ZELTIA SA                                | 4241 | ZENITH NATIONAL INSURANCE CP | 4242 | ZEON CORP                    |
| 4243 | ZIMMER HOLDINGS INC                      | 4244 | ZINIFEX LTD                  | 4245 | ZIONS BANCORPORATION         |
| 4246 | ZODIAC SA                                | 4247 | ZOLTEK COMPANIES INC         | 4248 | ZUMTOBEL AG                  |
| 4249 | ZURICH FINANCIAL SERVICE-REG             |      |                              |      |                              |

## 【附註說明】

結構型債券連結之標的若為股票時，基於下列情況，結構型債券計算機構（大部分之計算機構即為發行機構）將調整個股及其股價，以維持連結個股於一固定數量及合理價位，但必須及時通知要保人：

### 1. 調整連結個股原因及方式

(1) 要保人必須瞭解在發生下列事件時，原先所設定之連結股票將會有所更改：

- 若個股於相關交易所之交易遭到暫停或是有所限制，以及相關個股之選擇權或期貨交易受到交易所限制時；
- 任何個股公司重整動作導致必須重新置換所有流通在外之股票、任何合併或是購併之動作導致股票之變換、或是任何其他公司意圖購併個股公司導致股票必須更換時；
- 個股公司被國有化或是發生倒閉情況時。

(2) 當上述之調整事件發生時，結構型債券計算機構在維持要保人權益之前提下，將選擇國際知名度、財務實力及信用評等相當類似，並盡可能為同一產業之個股，以替換調整所受影響之原先連結個股。惟替換個股之起始價格須依下列方法進行調整：

- 若調整事件造成受影響個股（Affected Share）之股票持有人有權取得其他新股時（如合併時以新股換取舊股），則以新股取代成為債券連動股票之一，惟新股票相對之起始價格須作下列調整：

$$\frac{\text{受影響個股（Affected Share）於債券發行日之起始價格}}{\text{每一舊股替換新股之股數} + \text{其他交換成本（換算為可交換之約當新股股數）}}$$

- 其他情況（如下市），替換個股之起始價格須作下列調整：

$$\frac{\text{受影響個股（Affected Share）之起始價格}}{\text{受影響個股於調整生效日收盤價}} \times \text{替換個股於調整生效日之收盤價}$$

（調整生效日為調整事件有效日後之次一評價日，惟若次一評價日之價格無法取得時，則為調整事件有效日前之最後收盤價）

### 2. 調整連結個股價格原因及方式

(1) 要保人必須瞭解在發生下列事件時，計算個股股票績效之股價將會有所更改：

- 任何形式的證券、權利、認股權證以及其他資產造成股價稀釋或濃縮之現象。
- 個股公司發放股票股利、或是股票分割、或是發放特別紅利（Special Bonus）、或是其他類似事件以致於稀釋或影響公司實際價值時。

(2) 當上述之調整事件發生時，個股收盤價將依除權比例和其他相關因素做調整，調整方式原則上係依個股相關證交所對各該事件所規定之調整方法進行之。

以發放股票股利及股票分割為例，該股票相對之起始價格須作下列調整：

$$\frac{\text{該股票於債券發行日之起始價格}}{\text{分割比率或（1 + 配股比率）}}$$

（註：個股公司發放一般現金股利時，該股票之起始價格並不會相對調整。）

三、「結構型債券到期金」及配息之計算公式及其範例說明—本契約提供之結構型債券，其「結構型債券到期金」

及配息計算方式為下列公式之一：

『第一種計算公式』

「結構型債券到期金」=「結構型債券淨投資金額」  
每一期期末依配息公式分配收益並依條款第十條之約定方式分配

一、配息公式：

第  $h$  期之收益分配 = 「結構型債券淨投資金額」 × 第  $h$  期之收益分配率

其中

1. 第  $h$  期之收益分配率 ( $R_h$ ) 之計算公式如下：

$$R_h = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ A_h + (B_h + PR_h \times \text{Portfolio}_h) \times \frac{g_h}{G_h}, \text{Floor}_h \right], \text{Cap}_h \right\}$$

2. 額外收益分配率：於「結構型債券到期日」除給付「結構型債券到期金」及當期收益分配率  $R_T$  外，另加發額外收益分配率  $ED_T$ 。

其中

$T$ ：「結構型債券投資期間」總期數， $T = \sum_{i=1}^H M_i$ 。

$H$ ：結構型債券之投資期間（年數）。

$M_i$ ：第  $i$  年度中之期數， $M_i = 12 / t_{mi}$ 。

$t_{mi}$ ：第  $i$  年度中每一期期間之月數（於每次銷售結構型債券時決定，可能為 1 個月、2 個月、3 個月、6 個月或 12 個月）。

第  $h$  期：係指自「結構型債券發行日」起以每  $t_{mi}$  個月為一期之週期；例如，假設每年以 6 個月為一期（ $t_{mi} = 6$ ， $M_i = 2$ ），而 2007/7/3 為結構型債券起始日，則第一期之期間為 2007/7/3 至 2008/1/2，第二期之期間為 2008/1/3 至 2008/7/2，第三期之期間為 2008/7/3 至 2009/1/2，以此類推；但每一期之期初及期末需為結構型債券評價日，若非結構型債券評價日時則需遞延至次一結構型債券評價日。

結構型債券評價日：係指該結構型債券所連結之標的所屬報價市場共同之營業日。

$A_h, B_h, PR_h, \text{Floor}_h, \text{Cap}_h$ ：此五組參數為計算配息之因子，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$g_h$ ：第  $h$  觀察期期間內，各參考指標結算值同時落在規定區間  $\text{Barrier}_h$  內之日數合計。參考指標可能為利率、即期匯價或股價指數，於每次銷售結構型債券時決定；本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$G_h$ ：第  $h$  觀察期期間內，計算參考指標之日數總計。

$\text{Barrier}_h$ ：第  $h$  觀察期之規定區間，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$ED_T$ ：額外收益分配率，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

而第  $h$  期之投資績效 ( $\text{Portfolio}_h$ ) 計算公式：

$$\text{Portfolio}_h = \sum_{n=1}^N W_n^h \times \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{\text{Underlying}_n^h - \text{Underlying}_n^0}{\text{Underlying}_n^0}, \text{UC}_h \right), \text{UF}_h \right]$$

其中

$N$ ：連結之標的個數。

$W_n^h$ ：第  $n$  個標的於第  $h$  期所佔之權重， $\sum_{n=1}^N W_n^h = 1$ 。

$\text{Underlying}_n^0$ ：第  $n$  個標的於「結構型債券發行日」之收盤值。

- $Underlying_n^h$  : 第  $n$  個標的於第  $h$  期期末前  $dh$  個結構型債券評價日之收盤值。
- $UC_h$  : 第  $h$  期時各連結標的前  $dh$  個結構型債券評價日之收盤值成長率上限。
- $UF_h$  : 第  $h$  期時各連結標的前  $dh$  個結構型債券評價日之收盤值成長率下限。
- $dh$  : 此參數為固定數值，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

## 二、範例說明

(本範例說明僅為使要保人更加了解「結構型債券到期金」及配息之計算方式，其引用數字僅做參考，不代表未來實際情況。)

### 【假設】

- 1997年8月8日為投入6年期( $H=6$ )結構型債券之發行日，「結構型債券淨投資金額」為10,000美元；
- 自「結構型債券發行日」起每6個月為一週期( $t_{mi}=6$ ， $M_i=12/t_{mi}=12/6=2$ ， $T=\sum_{i=1}^H M_i=\sum_{i=1}^6 2=12$ )；
- 連結之標的為5支股票( $N=5$ )，每期之投資績效權重為5支股票之績效平均( $W_1^h=W_2^h=\dots=W_5^h=1/5$ )；
- $A_h=0\%$ ， $B_h=3\%$ ， $PR_h=150\%$ ， $Floor_h=0\%$ ， $Cap_h=10\%$ ， $dh=5$ ， $UC_h=50\%$ ， $UF_h=-20\%$ ；
- 額外收益分配率：於「結構型債券到期日」加發8% (即  $ED_T=8\%$ )。
- 每一觀察期之規定區間  $Barrier_h$  如下：

| 期數 $h$ | 規定區間 $Barrier_h$ |
|--------|------------------|
| 1      | 0%~5.75%         |
| 2      | 0%~5.75%         |
| 3      | 0%~5.75%         |
| 4      | 0%~5.75%         |
| 5      | 0%~6.25%         |
| 6      | 0%~6.25%         |
| 7      | 0%~6.25%         |
| 8      | 0%~6.25%         |
| 9      | 0%~6.5%          |
| 10     | 0%~6.5%          |
| 11     | 0%~6.5%          |
| 12     | 0%~6.5%          |

【說明】各期收益分配及「結構型債券到期金」計算步驟如下：

- 第1期期間 (1997/8/8~1998/2/7)， $h=1$

(1). 假設該5支股票之股價變化如下表：

|                                      | T US  | DOW US | MRK US | VZ US | BLS US |
|--------------------------------------|-------|--------|--------|-------|--------|
| 「結構型債券發行日」1997/8/8之收盤值               | 42.93 | 31.04  | 46.76  | 36.59 | 23.00  |
| 第1期期末1998/2/7前5個結構型債券評價日1998/2/2之收盤值 | 66.68 | 31.50  | 55.72  | 46.44 | 31.13  |

則第1期投資績效  $Portfolio_1 =$

$$\frac{1}{5} \times \left\{ \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{66.68}{42.93} - 1, 50\% \right), -20\% \right] + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{31.50}{31.04} - 1, 50\% \right), -20\% \right] + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{55.72}{46.76} - 1, 50\% \right), -20\% \right] \right\}$$



$$= \text{Min}\{\text{Max}[7.69\%, 0\%], 10\%\} = 7.69\%$$

收益分配 = 10000 美元 × 7.69% = 769 美元

- 第 2 期期間 (1998/2/8~1998/8/7),  $h = 2$

(1). 假設該 5 支股票之股價變化如下表：

|   | T US  | DOW US | MRK US | VZ US | BLS US |
|---|-------|--------|--------|-------|--------|
| 「結構型債券發行日」1997/8/8 之收盤值                       | 42.93 | 31.04  | 46.76  | 36.59 | 23.00  |
| 第 2 期期末 1998/8/7 前 5 個結構型債券評價日 1998/7/31 之收盤值 | 63.16 | 30.23  | 57.50  | 46.63 | 34.72  |

則第 2 期投資績效  $\text{Portfolio}_2 =$

$$\begin{aligned} & \frac{1}{5} \times \left\{ \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{63.16}{42.93} - 1, 50\% \right), -20\% \right] + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{30.23}{31.04} - 1, 50\% \right), -20\% \right] + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{57.50}{46.76} - 1, 50\% \right), -20\% \right] \right. \\ & \left. + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{46.63}{36.59} - 1, 50\% \right), -20\% \right] + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{34.72}{23.00} - 1, 50\% \right), -20\% \right] \right\} \\ & = \frac{1}{5} \times [47.12\% + (-2.61\%) + 22.97\% + 27.44\% + 50.00\%] = 28.98\% \end{aligned}$$

(2). 假設第 2 觀察期 (1998/2/8~1998/8/7) 之 6 個月美元 LIBOR 利率每日變化如下表：

|    | 1              |       | 2              |       | 3              |       | 4              |       | 5              |       |
|----|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|
|    | LIBOR 報價市場之評價日 | LIBOR |
| 1  | 1998/2/8       | 5.63% | 1998/3/17      | 5.69% | 1998/4/23      | 5.75% | 1998/5/30      | 5.75% | 1998/7/6       | 5.75% |
| 2  | 1998/2/9       | 5.63% | 1998/3/18      | 5.69% | 1998/4/24      | 5.78% | 1998/5/31      | 5.75% | 1998/7/7       | 5.75% |
| 3  | 1998/2/10      | 5.65% | 1998/3/19      | 5.69% | 1998/4/25      | 5.78% | 1998/6/1       | 5.74% | 1998/7/8       | 5.75% |
| 4  | 1998/2/11      | 5.66% | 1998/3/20      | 5.71% | 1998/4/26      | 5.78% | 1998/6/2       | 5.74% | 1998/7/9       | 5.75% |
| 5  | 1998/2/12      | 5.66% | 1998/3/21      | 5.71% | 1998/4/27      | 5.78% | 1998/6/3       | 5.75% | 1998/7/10      | 5.75% |
| 6  | 1998/2/13      | 5.63% | 1998/3/22      | 5.71% | 1998/4/28      | 5.81% | 1998/6/4       | 5.75% | 1998/7/11      | 5.75% |
| 7  | 1998/2/14      | 5.63% | 1998/3/23      | 5.71% | 1998/4/29      | 5.81% | 1998/6/5       | 5.75% | 1998/7/12      | 5.75% |
| 8  | 1998/2/15      | 5.63% | 1998/3/24      | 5.71% | 1998/4/30      | 5.81% | 1998/6/6       | 5.75% | 1998/7/13      | 5.75% |
| 9  | 1998/2/16      | 5.63% | 1998/3/25      | 5.72% | 1998/5/1       | 5.78% | 1998/6/7       | 5.75% | 1998/7/14      | 5.75% |
| 10 | 1998/2/17      | 5.63% | 1998/3/26      | 5.74% | 1998/5/2       | 5.78% | 1998/6/8       | 5.75% | 1998/7/15      | 5.75% |
| 11 | 1998/2/18      | 5.63% | 1998/3/27      | 5.75% | 1998/5/3       | 5.78% | 1998/6/9       | 5.75% | 1998/7/16      | 5.75% |
| 12 | 1998/2/19      | 5.63% | 1998/3/28      | 5.75% | 1998/5/4       | 5.78% | 1998/6/10      | 5.75% | 1998/7/17      | 5.75% |
| 13 | 1998/2/20      | 5.63% | 1998/3/29      | 5.75% | 1998/5/5       | 5.78% | 1998/6/11      | 5.75% | 1998/7/18      | 5.75% |
| 14 | 1998/2/21      | 5.63% | 1998/3/30      | 5.75% | 1998/5/6       | 5.78% | 1998/6/12      | 5.72% | 1998/7/19      | 5.75% |
| 15 | 1998/2/22      | 5.63% | 1998/3/31      | 5.75% | 1998/5/7       | 5.75% | 1998/6/13      | 5.72% | 1998/7/20      | 5.75% |
| 16 | 1998/2/23      | 5.63% | 1998/4/1       | 5.75% | 1998/5/8       | 5.75% | 1998/6/14      | 5.72% | 1998/7/21      | 5.75% |
| 17 | 1998/2/24      | 5.66% | 1998/4/2       | 5.75% | 1998/5/9       | 5.75% | 1998/6/15      | 5.72% | 1998/7/22      | 5.75% |
| 18 | 1998/2/25      | 5.69% | 1998/4/3       | 5.72% | 1998/5/10      | 5.75% | 1998/6/16      | 5.72% | 1998/7/23      | 5.75% |
| 19 | 1998/2/26      | 5.70% | 1998/4/4       | 5.72% | 1998/5/11      | 5.75% | 1998/6/17      | 5.72% | 1998/7/24      | 5.75% |
| 20 | 1998/2/27      | 5.70% | 1998/4/5       | 5.72% | 1998/5/12      | 5.78% | 1998/6/18      | 5.75% | 1998/7/25      | 5.75% |
| 21 | 1998/2/28      | 5.70% | 1998/4/6       | 5.69% | 1998/5/13      | 5.76% | 1998/6/19      | 5.75% | 1998/7/26      | 5.75% |
| 22 | 1998/3/1       | 5.70% | 1998/4/7       | 5.69% | 1998/5/14      | 5.75% | 1998/6/20      | 5.75% | 1998/7/27      | 5.75% |
| 23 | 1998/3/2       | 5.69% | 1998/4/8       | 5.69% | 1998/5/15      | 5.77% | 1998/6/21      | 5.75% | 1998/7/28      | 5.75% |
| 24 | 1998/3/3       | 5.72% | 1998/4/9       | 5.69% | 1998/5/16      | 5.77% | 1998/6/22      | 5.74% | 1998/7/29      | 5.75% |
| 25 | 1998/3/4       | 5.72% | 1998/4/10      | 5.69% | 1998/5/17      | 5.77% | 1998/6/23      | 5.75% | 1998/7/30      | 5.75% |
| 26 | 1998/3/5       | 5.71% | 1998/4/11      | 5.69% | 1998/5/18      | 5.78% | 1998/6/24      | 5.75% | 1998/7/31      | 5.75% |
| 27 | 1998/3/6       | 5.72% | 1998/4/12      | 5.69% | 1998/5/19      | 5.78% | 1998/6/25      | 5.75% | 1998/8/1       | 5.75% |
| 28 | 1998/3/7       | 5.72% | 1998/4/13      | 5.69% | 1998/5/20      | 5.77% | 1998/6/26      | 5.75% | 1998/8/2       | 5.75% |
| 29 | 1998/3/8       | 5.72% | 1998/4/14      | 5.72% | 1998/5/21      | 5.75% | 1998/6/27      | 5.75% | 1998/8/3       | 5.75% |
| 30 | 1998/3/9       | 5.72% | 1998/4/15      | 5.72% | 1998/5/22      | 5.78% | 1998/6/28      | 5.75% | 1998/8/4       | 5.75% |
| 31 | 1998/3/10      | 5.72% | 1998/4/16      | 5.72% | 1998/5/23      | 5.78% | 1998/6/29      | 5.78% | 1998/8/5       | 5.75% |
| 32 | 1998/3/11      | 5.72% | 1998/4/17      | 5.72% | 1998/5/24      | 5.78% | 1998/6/30      | 5.78% | 1998/8/6       | 5.75% |
| 33 | 1998/3/12      | 5.71% | 1998/4/18      | 5.72% | 1998/5/25      | 5.78% | 1998/7/1       | 5.78% | 1998/8/7       | 5.75% |
| 34 | 1998/3/13      | 5.69% | 1998/4/19      | 5.72% | 1998/5/26      | 5.78% | 1998/7/2       | 5.75% |                |       |

|    | 1              |       | 2              |       | 3              |       | 4              |       | 5              |       |
|----|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|
|    | LIBOR 報價市場之評價日 | LIBOR |
| 35 | 1998/3/14      | 5.69% | 1998/4/20      | 5.72% | 1998/5/27      | 5.75% | 1998/7/3       | 5.75% |                |       |
| 36 | 1998/3/15      | 5.69% | 1998/4/21      | 5.75% | 1998/5/28      | 5.75% | 1998/7/4       | 5.75% |                |       |
| 37 | 1998/3/16      | 5.69% | 1998/4/22      | 5.75% | 1998/5/29      | 5.75% | 1998/7/5       | 5.75% |                |       |

註：1.該日非 LIBOR 報價日時，其利率以前一報價日之利率計算。

2.觀察日後之利率（1998/8/1 至 1998/8/7）以觀察日之利率估算。

則

$G_2$  = 第 2 觀察期期間內，所有 6 個月美元 LIBOR 利率報價市場之評價日數（即上表所列日數）=181(日)

$g_2$  = 第 2 觀察期期間內，6 個月美元 LIBOR 利率落在規定區間 0%~5.75% 內之日數合計（即上表所列陰影區域之日數）

= 152(日)

(3).綜合(1)、(2)第 2 期之收益分配率

$$R_2 = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 3\% + 150\% \times \text{Portfolio}_2 \right) \times \frac{g_2}{G_2}, 0\% \right], 10\% \right\}$$

$$= \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 3\% + 150\% \times 28.98\% \right) \times \frac{152}{181}, 0\% \right], 10\% \right\} = \text{Min} \left\{ \text{Max} [39.02\%, 0\%], 10\% \right\} = 10\%$$

收益分配=10000 美元 × 10% = 1000 美元

● 第 3 期期間（1998/8/8~1999/2/7）， $h=3$

(1).假設該 5 支股票之股價變化如下表：

|  | T US  | DOW US | MRK US | VZ US | BLS US |
|--|-------|--------|--------|-------|--------|
| 「結構型債券發行日」1997/8/8 之收盤值                      | 42.93 | 31.04  | 46.76  | 36.59 | 23.00  |
| 第 3 期期末 1999/2/7 前 5 個結構型債券評價日 1999/2/1 之收盤值 | 99.32 | 30.27  | 69.54  | 59.50 | 45.13  |

則第 3 期投資績效  $\text{Portfolio}_3 =$

$$\frac{1}{5} \times \left\{ \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{99.32}{42.93} - 1, 50\% \right), -20\% \right] + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{30.27}{31.04} - 1, 50\% \right), -20\% \right] + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{69.54}{46.76} - 1, 50\% \right), -20\% \right] \right.$$

$$\left. + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{59.50}{36.59} - 1, 50\% \right), -20\% \right] + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{45.13}{23.00} - 1, 50\% \right), -20\% \right] \right\}$$

$$= \frac{1}{5} \times [50.00\% + (-2.48\%) + 48.72\% + 50.00\% + 50.00\%] = 39.25\%$$

(2).假設第 3 觀察期（1998/8/8~1999/2/7）之 6 個月美元 LIBOR 利率每日變化如下表：

|    | 1              |       | 2              |       | 3              |       | 4              |       | 5              |       |
|----|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|
|    | LIBOR 報價市場之評價日 | LIBOR |
| 1  | 1998/8/8       | 5.75% | 1998/9/14      | 5.41% | 1998/10/21     | 4.95% | 1998/11/27     | 5.15% | 1999/1/3       | 5.07% |
| 2  | 1998/8/9       | 5.75% | 1998/9/15      | 5.41% | 1998/10/22     | 4.96% | 1998/11/28     | 5.15% | 1999/1/4       | 5.06% |
| 3  | 1998/8/10      | 5.72% | 1998/9/16      | 5.41% | 1998/10/23     | 4.97% | 1998/11/29     | 5.15% | 1999/1/5       | 5.06% |
| 4  | 1998/8/11      | 5.72% | 1998/9/17      | 5.41% | 1998/10/24     | 4.97% | 1998/11/30     | 5.15% | 1999/1/6       | 5.06% |
| 5  | 1998/8/12      | 5.72% | 1998/9/18      | 5.41% | 1998/10/25     | 4.97% | 1998/12/1      | 5.15% | 1999/1/7       | 5.06% |
| 6  | 1998/8/13      | 5.72% | 1998/9/19      | 5.41% | 1998/10/26     | 4.97% | 1998/12/2      | 5.13% | 1999/1/8       | 5.06% |
| 7  | 1998/8/14      | 5.72% | 1998/9/20      | 5.41% | 1998/10/27     | 4.99% | 1998/12/3      | 5.10% | 1999/1/9       | 5.06% |
| 8  | 1998/8/15      | 5.72% | 1998/9/21      | 5.41% | 1998/10/28     | 4.97% | 1998/12/4      | 5.08% | 1999/1/10      | 5.06% |
| 9  | 1998/8/16      | 5.72% | 1998/9/22      | 5.41% | 1998/10/29     | 4.97% | 1998/12/5      | 5.08% | 1999/1/11      | 5.08% |
| 10 | 1998/8/17      | 5.72% | 1998/9/23      | 5.41% | 1998/10/30     | 4.98% | 1998/12/6      | 5.08% | 1999/1/12      | 5.09% |
| 11 | 1998/8/18      | 5.72% | 1998/9/24      | 5.34% | 1998/10/31     | 4.98% | 1998/12/7      | 5.10% | 1999/1/13      | 5.03% |
| 12 | 1998/8/19      | 5.72% | 1998/9/25      | 5.25% | 1998/11/1      | 4.98% | 1998/12/8      | 5.12% | 1999/1/14      | 5.01% |
| 13 | 1998/8/20      | 5.72% | 1998/9/26      | 5.25% | 1998/11/2      | 5.06% | 1998/12/9      | 5.09% | 1999/1/15      | 4.97% |
| 14 | 1998/8/21      | 5.72% | 1998/9/27      | 5.25% | 1998/11/3      | 5.11% | 1998/12/10     | 5.07% | 1999/1/16      | 4.97% |

|    | 1              |       | 2              |       | 3              |       | 4              |       | 5              |       |
|----|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|
|    | LIBOR 報價市場之評價日 | LIBOR |
| 15 | 1998/8/22      | 5.72% | 1998/9/28      | 5.25% | 1998/11/4      | 5.13% | 1998/12/11     | 5.04% | 1999/1/17      | 4.97% |
| 16 | 1998/8/23      | 5.72% | 1998/9/29      | 5.25% | 1998/11/5      | 5.19% | 1998/12/12     | 5.04% | 1999/1/18      | 4.99% |
| 17 | 1998/8/24      | 5.69% | 1998/9/30      | 5.25% | 1998/11/6      | 5.19% | 1998/12/13     | 5.04% | 1999/1/19      | 4.97% |
| 18 | 1998/8/25      | 5.69% | 1998/10/1      | 5.21% | 1998/11/7      | 5.19% | 1998/12/14     | 5.06% | 1999/1/20      | 5.00% |
| 19 | 1998/8/26      | 5.69% | 1998/10/2      | 5.13% | 1998/11/8      | 5.19% | 1998/12/15     | 5.06% | 1999/1/21      | 5.00% |
| 20 | 1998/8/27      | 5.69% | 1998/10/3      | 5.13% | 1998/11/9      | 5.23% | 1998/12/16     | 5.06% | 1999/1/22      | 4.97% |
| 21 | 1998/8/28      | 5.59% | 1998/10/4      | 5.13% | 1998/11/10     | 5.19% | 1998/12/17     | 5.06% | 1999/1/23      | 4.97% |
| 22 | 1998/8/29      | 5.59% | 1998/10/5      | 5.13% | 1998/11/11     | 5.19% | 1998/12/18     | 5.06% | 1999/1/24      | 4.97% |
| 23 | 1998/8/30      | 5.59% | 1998/10/6      | 5.14% | 1998/11/12     | 5.20% | 1998/12/19     | 5.06% | 1999/1/25      | 4.97% |
| 24 | 1998/8/31      | 5.59% | 1998/10/7      | 5.19% | 1998/11/13     | 5.19% | 1998/12/20     | 5.06% | 1999/1/26      | 4.97% |
| 25 | 1998/9/1       | 5.56% | 1998/10/8      | 5.16% | 1998/11/14     | 5.19% | 1998/12/21     | 5.06% | 1999/1/27      | 4.97% |
| 26 | 1998/9/2       | 5.56% | 1998/10/9      | 5.15% | 1998/11/15     | 5.19% | 1998/12/22     | 5.11% | 1999/1/28      | 4.97% |
| 27 | 1998/9/3       | 5.56% | 1998/10/10     | 5.15% | 1998/11/16     | 5.21% | 1998/12/23     | 5.12% | 1999/1/29      | 4.97% |
| 28 | 1998/9/4       | 5.56% | 1998/10/11     | 5.15% | 1998/11/17     | 5.19% | 1998/12/24     | 5.16% | 1999/1/30      | 4.97% |
| 29 | 1998/9/5       | 5.56% | 1998/10/12     | 5.16% | 1998/11/18     | 5.06% | 1998/12/25     | 5.16% | 1999/1/31      | 4.97% |
| 30 | 1998/9/6       | 5.56% | 1998/10/13     | 5.16% | 1998/11/19     | 5.09% | 1998/12/26     | 5.16% | 1999/2/1       | 4.98% |
| 31 | 1998/9/7       | 5.54% | 1998/10/14     | 5.16% | 1998/11/20     | 5.12% | 1998/12/27     | 5.16% | 1999/2/2       | 4.98% |
| 32 | 1998/9/8       | 5.53% | 1998/10/15     | 5.16% | 1998/11/21     | 5.12% | 1998/12/28     | 5.16% | 1999/2/3       | 4.98% |
| 33 | 1998/9/9       | 5.50% | 1998/10/16     | 4.94% | 1998/11/22     | 5.12% | 1998/12/29     | 5.16% | 1999/2/4       | 4.98% |
| 34 | 1998/9/10      | 5.50% | 1998/10/17     | 4.94% | 1998/11/23     | 5.12% | 1998/12/30     | 5.08% | 1999/2/5       | 4.98% |
| 35 | 1998/9/11      | 5.41% | 1998/10/18     | 4.94% | 1998/11/24     | 5.13% | 1998/12/31     | 5.07% | 1999/2/6       | 4.98% |
| 36 | 1998/9/12      | 5.41% | 1998/10/19     | 4.94% | 1998/11/25     | 5.13% | 1999/1/1       | 5.07% | 1999/2/7       | 4.98% |
| 37 | 1998/9/13      | 5.41% | 1998/10/20     | 4.94% | 1998/11/26     | 5.13% | 1999/1/2       | 5.07% |                |       |

註：1.該日非 LIBOR 報價日時，其利率以前一報價日之利率計算。

2.觀察日後之利率（1999/2/2 至 1999/2/7）以觀察日之利率估算。

則

$G_3$  = 第 3 觀察期期間內，所有 6 個月美元 LIBOR 利率報價市場之評價日數（即上表所列日數）=184(日)

$g_3$  = 第 3 觀察期期間內，6 個月美元 LIBOR 利率落在規定區間 0%~5.75% 內之日數合計（即上表所列陰影區域之日數）

= 184(日)

(3).綜合(1)、(2)第 3 期之收益分配率

$$R_3 = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 3\% + 150\% \times \text{Portfolio}_3 \right) \times \frac{g_3}{G_3}, 0\% \right], 10\% \right\}$$

$$= \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 3\% + 150\% \times 39.25\% \right) \times \frac{184}{184}, 0\% \right], 10\% \right\} = \text{Min} \left\{ \text{Max} [61.88\%, 0\%], 10\% \right\} = 10\%$$

收益分配=10000 美元 × 10% = 1000 美元

.....

● 第 12 期期間（2003/2/8~2003/8/7）， $h = 12$ （最後一期）

(1).假設該 5 支股票之股價變化如下表：

|  | T US  | DOW US | MRK US | VZ US | BLS US |
|--|-------|--------|--------|-------|--------|
| 「結構型債券發行」日 1997/8/8 之收盤值                       | 42.93 | 31.04  | 46.76  | 36.59 | 23.00  |
| 第 12 期期末 2003/8/7 前 5 個結構型債券評價日 2003/7/31 之收盤值 | 23.36 | 35.30  | 52.32  | 33.57 | 25.47  |

則第 12 期投資績效  $\text{Portfolio}_4 =$

$$\frac{1}{5} \times \left\{ \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{23.36}{42.93} - 1, 50\% \right), -20\% \right] + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{35.30}{31.04} - 1, 50\% \right), -20\% \right] + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{52.32}{46.76} - 1, 50\% \right), -20\% \right] \right.$$

$$\left. + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{33.57}{36.59} - 1, 50\% \right), -20\% \right] + \text{Max} \left[ \text{Min} \left( \frac{25.47}{23.00} - 1, 50\% \right), -20\% \right] \right\}$$

$$= \frac{1}{5} \times [-45.59\% + 13.72\% + 11.89\% + (-8.25\%) + 10.74\%] = -3.50\%$$

(2). 假設第 12 觀察期 (2003/2/8~2003/8/7) 之 6 個月美元 LIBOR 利率每日變化如下表：

|    | 1              |       | 2              |       | 3              |       | 4              |       | 5              |       |
|----|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|----------------|-------|
|    | LIBOR 報價市場之評價日 | LIBOR |
| 1  | 2003/2/8       | 1.35% | 2003/3/17      | 1.22% | 2003/4/23      | 1.32% | 2003/5/30      | 1.21% | 2003/7/6       | 1.12% |
| 2  | 2003/2/9       | 1.35% | 2003/3/18      | 1.24% | 2003/4/24      | 1.32% | 2003/5/31      | 1.21% | 2003/7/7       | 1.12% |
| 3  | 2003/2/10      | 1.35% | 2003/3/19      | 1.27% | 2003/4/25      | 1.29% | 2003/6/1       | 1.21% | 2003/7/8       | 1.12% |
| 4  | 2003/2/11      | 1.35% | 2003/3/20      | 1.28% | 2003/4/26      | 1.29% | 2003/6/2       | 1.24% | 2003/7/9       | 1.12% |
| 5  | 2003/2/12      | 1.34% | 2003/3/21      | 1.28% | 2003/4/27      | 1.29% | 2003/6/3       | 1.23% | 2003/7/10      | 1.12% |
| 6  | 2003/2/13      | 1.34% | 2003/3/22      | 1.28% | 2003/4/28      | 1.27% | 2003/6/4       | 1.18% | 2003/7/11      | 1.11% |
| 7  | 2003/2/14      | 1.34% | 2003/3/23      | 1.28% | 2003/4/29      | 1.29% | 2003/6/5       | 1.16% | 2003/7/12      | 1.11% |
| 8  | 2003/2/15      | 1.34% | 2003/3/24      | 1.28% | 2003/4/30      | 1.29% | 2003/6/6       | 1.14% | 2003/7/13      | 1.11% |
| 9  | 2003/2/16      | 1.34% | 2003/3/25      | 1.28% | 2003/5/1       | 1.26% | 2003/6/7       | 1.14% | 2003/7/14      | 1.11% |
| 10 | 2003/2/17      | 1.34% | 2003/3/26      | 1.28% | 2003/5/2       | 1.25% | 2003/6/8       | 1.14% | 2003/7/15      | 1.11% |
| 11 | 2003/2/18      | 1.34% | 2003/3/27      | 1.27% | 2003/5/3       | 1.25% | 2003/6/9       | 1.14% | 2003/7/16      | 1.13% |
| 12 | 2003/2/19      | 1.34% | 2003/3/28      | 1.26% | 2003/5/4       | 1.25% | 2003/6/10      | 1.11% | 2003/7/17      | 1.12% |
| 13 | 2003/2/20      | 1.34% | 2003/3/29      | 1.26% | 2003/5/5       | 1.25% | 2003/6/11      | 1.07% | 2003/7/18      | 1.12% |
| 14 | 2003/2/21      | 1.34% | 2003/3/30      | 1.26% | 2003/5/6       | 1.26% | 2003/6/12      | 1.06% | 2003/7/19      | 1.12% |
| 15 | 2003/2/22      | 1.34% | 2003/3/31      | 1.23% | 2003/5/7       | 1.24% | 2003/6/13      | 1.03% | 2003/7/20      | 1.12% |
| 16 | 2003/2/23      | 1.34% | 2003/4/1       | 1.23% | 2003/5/8       | 1.24% | 2003/6/14      | 1.03% | 2003/7/21      | 1.12% |
| 17 | 2003/2/24      | 1.34% | 2003/4/2       | 1.24% | 2003/5/9       | 1.26% | 2003/6/15      | 1.03% | 2003/7/22      | 1.13% |
| 18 | 2003/2/25      | 1.34% | 2003/4/3       | 1.24% | 2003/5/10      | 1.26% | 2003/6/16      | 1.00% | 2003/7/23      | 1.13% |
| 19 | 2003/2/26      | 1.34% | 2003/4/4       | 1.22% | 2003/5/11      | 1.26% | 2003/6/17      | 1.01% | 2003/7/24      | 1.12% |
| 20 | 2003/2/27      | 1.34% | 2003/4/5       | 1.22% | 2003/5/12      | 1.25% | 2003/6/18      | 1.04% | 2003/7/25      | 1.12% |
| 21 | 2003/2/28      | 1.34% | 2003/4/6       | 1.22% | 2003/5/13      | 1.25% | 2003/6/19      | 0.99% | 2003/7/26      | 1.12% |
| 22 | 2003/3/1       | 1.34% | 2003/4/7       | 1.27% | 2003/5/14      | 1.25% | 2003/6/20      | 1.00% | 2003/7/27      | 1.12% |
| 23 | 2003/3/2       | 1.34% | 2003/4/8       | 1.27% | 2003/5/15      | 1.24% | 2003/6/21      | 1.00% | 2003/7/28      | 1.13% |
| 24 | 2003/3/3       | 1.34% | 2003/4/9       | 1.25% | 2003/5/16      | 1.25% | 2003/6/22      | 1.00% | 2003/7/29      | 1.14% |
| 25 | 2003/3/4       | 1.33% | 2003/4/10      | 1.23% | 2003/5/17      | 1.25% | 2003/6/23      | 1.00% | 2003/7/30      | 1.15% |
| 26 | 2003/3/5       | 1.32% | 2003/4/11      | 1.26% | 2003/5/18      | 1.25% | 2003/6/24      | 0.99% | 2003/7/31      | 1.15% |
| 27 | 2003/3/6       | 1.31% | 2003/4/12      | 1.26% | 2003/5/19      | 1.21% | 2003/6/25      | 0.98% | 2003/8/1       | 1.15% |
| 28 | 2003/3/7       | 1.31% | 2003/4/13      | 1.26% | 2003/5/20      | 1.22% | 2003/6/26      | 1.10% | 2003/8/2       | 1.15% |
| 29 | 2003/3/8       | 1.31% | 2003/4/14      | 1.30% | 2003/5/21      | 1.19% | 2003/6/27      | 1.12% | 2003/8/3       | 1.15% |
| 30 | 2003/3/9       | 1.31% | 2003/4/15      | 1.33% | 2003/5/22      | 1.22% | 2003/6/28      | 1.12% | 2003/8/4       | 1.15% |
| 31 | 2003/3/10      | 1.21% | 2003/4/16      | 1.33% | 2003/5/23      | 1.21% | 2003/6/29      | 1.12% | 2003/8/5       | 1.15% |
| 32 | 2003/3/11      | 1.17% | 2003/4/17      | 1.32% | 2003/5/24      | 1.21% | 2003/6/30      | 1.12% | 2003/8/6       | 1.15% |
| 33 | 2003/3/12      | 1.18% | 2003/4/18      | 1.32% | 2003/5/25      | 1.21% | 2003/7/1       | 1.12% | 2003/8/7       | 1.15% |
| 34 | 2003/3/13      | 1.23% | 2003/4/19      | 1.32% | 2003/5/26      | 1.21% | 2003/7/2       | 1.12% |                |       |
| 35 | 2003/3/14      | 1.26% | 2003/4/20      | 1.32% | 2003/5/27      | 1.21% | 2003/7/3       | 1.12% |                |       |
| 36 | 2003/3/15      | 1.26% | 2003/4/21      | 1.32% | 2003/5/28      | 1.23% | 2003/7/4       | 1.12% |                |       |
| 37 | 2003/3/16      | 1.26% | 2003/4/22      | 1.32% | 2003/5/29      | 1.22% | 2003/7/5       | 1.12% |                |       |

註：1. 該日非 LIBOR 報價日時，其利率以前一報價日之利率計算。

2. 觀察日後之利率 (2003/8/1 至 2003/8/7) 以觀察日之利率估算。

則

$G_{12}$  = 第 12 觀察期期間內，所有 6 個月美元 LIBOR 利率報價市場之評價日數 (即上表所列日數) = 181(日)

$g_{12}$  = 第 12 觀察期期間內，6 個月美元 LIBOR 利率落在規定區間 0%~6.50% 內之日數合計 = 181(日)

(3). 綜合(1)、(2)第 12 期之收益分配率

$$R_{12} = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 3\% + 150\% \times \text{Portfolio}_{12} \right) \times \frac{g_{12}}{G_{12}}, 0\% \right], 10\% \right\}$$

$$= \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 3\% + 150\% \times (-3.50\%) \right) \times \frac{181}{181}, 0\% \right], 10\% \right\} = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ -2.25\%, 0\% \right], 10\% \right\} = 0\%$$

收益分配 = 10000 美元 × 0% = 0 美元

「結構型債券到期金」及「額外收益分配金額」計算步驟如下：

「結構型債券到期金」 = 「結構型債券淨投資金額」 = 10,000 美元

另加發額外收益分配率 8%，即加發額外收益分配金額 = 10,000 美元 × 8% = 800 美元。

『第二種計算公式』

「結構型債券到期金」=「結構型債券淨投資金額」

每一期期末依配息公式分配收益並依條款第十條之約定方式分配

一、配息公式：

第  $h$  期之收益分配 = 「結構型債券淨投資金額」 × 第  $h$  期之收益分配率

其中

第  $h$  期之收益分配率 ( $R_h$ ) 之計算公式如下：

$$R_h = \text{Max}(D_h, E_h + F_h \times \text{Portfolio}_h)$$

其中

$T$ ：「結構型債券投資期間」總期數， $T = \sum_{i=1}^H M_i$ 。

$H$ ：結構型債券之投資期間（年數）。

$M_i$ ：第  $i$  年度中之期數， $M_i = 12 / t_{mi}$ 。

$t_{mi}$ ：第  $i$  年度中每一期期間之月數（於每次銷售結構型債券時決定，可能為 1 個月、2 個月、3 個月、6 個月或 12 個月）。

第  $h$  期：係指自「結構型債券發行日」起以每  $t_{mi}$  個月為一期之週期；例如，假設每年以 6 個月為一期（ $t_{mi} = 6$ ， $M_i = 2$ ），而 2007/7/3 為「結構型債券發行日」，則第一期之期間為 2007/7/3 至 2008/1/2，第二期之期間為 2008/1/3 至 2008/7/2，第三期之期間為 2008/7/3 至 2009/1/2，以此類推；但每一期之期初及期末需為結構型債券評價日，若非結構型債券評價日時則需遞延至次一結構型債券評價日。

結構型債券評價日：係指該結構型債券所連結之標的所屬報價市場共同之評價日。

$D_h, E_h, F_h$ ：此三組參數為計算配息之因子，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

而第  $h$  期之投資績效 ( $\text{Portfolio}_h$ ) 計算公式： $\text{Portfolio}_h = \sum_{n=1}^N W_n^h \times \text{UnderlyingAdj}_n^h$

$$\text{而 } \text{UnderlyingAdj}_n^h = \begin{cases} XX & \text{假如 } \text{Underlying}_n^h > \text{Underlying}_n^0 \\ & \text{或 } \text{UnderlyingAdj}_n^{h-1} > 0 \\ \frac{\text{Underlying}_n^h - \text{Underlying}_n^0}{\text{Underlying}_n^0} & \text{其他} \end{cases}$$

其中

$N$ ：連結之標的個數。

$W_n^h$ ：第  $n$  個標的於第  $h$  期所佔之權重， $\sum_{n=1}^N W_n^h = 1$ 。

$\text{Underlying}_n^0$ ：第  $n$  個標的於「結構型債券發行日」之收盤值。

$\text{Underlying}_n^h$ ：第  $n$  個標的於第  $h$  期期末前  $dh$  個結構型債券評價日之收盤值。

$XX$ ：為一大於 0 之固定值，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$dh$ ：此參數為固定數值，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

二、範例說明

（本範例說明僅為使要保人更加了解「結構型債券到期金」及配息之計算方式，其引用數字僅做參考，不代表未來實際情況。）

【假設】

1.1997 年 7 月 31 日為投入 6 年期 ( $H=6$ ) 結構型債券之發行日，「結構型債券淨投資金額」為 10,000 美元；

- 2.自「結構型債券發行日」起每6個月為一週期 ( $t_{mi}=6$ ,  $M_i=12/t_{mi}=12/6=2$ ,  $T=\sum_{i=1}^H M_i=\sum_{i=1}^6 2=12$ );
- 3.連結之標的為10支股票 ( $N=10$ ), 每期之投資績效權重為10支股票之績效平均 ( $W_1^h=W_2^h=\dots=W_{10}^h=1/10$ );
4. $D_h=0\%$ ,  $E_h=4\%$ ,  $F_h=2\%$ ,  $XX=12\%$ ,  $dh=5$ ;

5.該10支股票之股價變化如下表:

| 期數<br>$h$       | 期末日期      | 期末前5個<br>評價日日期 | AIG<br>US | AXP<br>US | BAC<br>US | DOW<br>US | GE<br>US | GM<br>US | JNJ<br>US | JPM<br>US | KO<br>US | PG<br>US |
|-----------------|-----------|----------------|-----------|-----------|-----------|-----------|----------|----------|-----------|-----------|----------|----------|
| 「結構型債券發行日」收盤價格  |           |                |           |           |           |           |          |          |           |           |          |          |
| 0               | 1997/7/31 |                | 37.87     | 27.92     | 71.19     | 31.67     | 23.38    | 48.88    | 31.06     | 37.85     | 69.13    | 37.74    |
| 每期期末前5個評價日之收盤價格 |           |                |           |           |           |           |          |          |           |           |          |          |
| 1               | 1998/2/2  | 1998/1/26      | 38.40     | 26.46     | 59.63     | 30.25     | 24.90    | 47.65    | 33.59     | 34.04     | 63.06    | 38.95    |
| 2               | 1998/7/31 | 1998/7/24      | 51.87     | 35.69     | 82.25     | 31.06     | 30.56    | 59.28    | 38.28     | 49.08     | 83.44    | 43.54    |
| 3               | 1999/2/1  | 1999/1/25      | 52.60     | 33.83     | 64.69     | 29.50     | 33.50    | 74.87    | 39.38     | 49.63     | 62.94    | 41.49    |
| 4               | 1999/8/2  | 1999/7/26      | 63.83     | 45.50     | 69.81     | 40.33     | 38.00    | 65.94    | 48.63     | 55.25     | 63.06    | 43.32    |
| 5               | 2000/1/31 | 2000/1/24      | 67.71     | 50.67     | 44.56     | 42.10     | 46.04    | 79.81    | 41.84     | 48.67     | 64.88    | 51.04    |
| 6               | 2000/7/31 | 2000/7/24      | 79.50     | 57.06     | 47.44     | 29.53     | 54.00    | 59.31    | 47.23     | 51.56     | 59.25    | 30.76    |
| 7               | 2001/1/31 | 2001/1/24      | 87.88     | 46.25     | 51.06     | 32.00     | 46.31    | 53.44    | 45.28     | 53.25     | 58.06    | 34.70    |
| 8               | 2001/7/31 | 2001/7/24      | 82.89     | 37.80     | 62.01     | 33.88     | 44.00    | 62.08    | 52.71     | 42.68     | 44.20    | 33.78    |
| 9               | 2002/1/31 | 2002/1/24      | 77.38     | 36.75     | 64.00     | 28.00     | 37.55    | 48.13    | 58.04     | 35.90     | 44.22    | 38.59    |
| 10              | 2002/7/31 | 2002/7/24      | 53.38     | 30.43     | 59.00     | 27.45     | 26.53    | 44.75    | 47.70     | 23.30     | 46.85    | 41.13    |
| 11              | 2003/1/31 | 2003/1/24      | 56.04     | 33.70     | 69.62     | 29.50     | 23.06    | 37.55    | 53.61     | 23.81     | 42.83    | 42.11    |
| 12              | 2003/7/31 | 2003/7/24      | 62.20     | 44.40     | 81.96     | 33.75     | 27.44    | 36.27    | 51.70     | 34.58     | 44.52    | 44.12    |

6.每期之股票績效及投資績效經計算如下:

| 期數<br>$h$ | 股票代碼<br>日期 | AIG US | AXP US | BAC US  | DOW US | GE US  | GM US  | JNJ US | JPM US  | KO US  | PG US  | 投資績效<br>$Portfolio_h$ |
|-----------|------------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|-----------------------|
| 1         | 1998/1/26  | 12.00% | -5.23% | -16.24% | -4.48% | 12.00% | -2.52% | 12.00% | -10.07% | -8.78% | 12.00% | 0.07%                 |
| 2         | 1998/7/24  | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | -1.93% | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 10.61%                |
| 3         | 1999/1/25  | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | -6.85% | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 10.12%                |
| 4         | 1999/7/26  | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00%                |
| 5         | 2000/1/24  | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00%                |
| 6         | 2000/7/24  | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00%                |
| 7         | 2001/1/24  | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00%                |
| 8         | 2001/7/24  | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00%                |
| 9         | 2002/1/24  | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00%                |
| 10        | 2002/7/24  | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00%                |
| 11        | 2003/1/24  | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00%                |
| 12        | 2003/7/24  | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00% | 12.00%  | 12.00% | 12.00% | 12.00%                |

計算說明:

第1期,  $h=1$

AIG US 因該股期末收盤價 38.40 超過發行日之收盤價 37.87, 故其個股績效=12%, 且以後各期之績效皆為 12%, 將不再重新計算。

AXP US 因該股期末收盤價 26.46 未超過發行日之收盤價 27.92, 故其個股績效=(26.46/27.92)-1=-5.23%

...

PG US 因該股期末收盤價 38.95 超過發行日之收盤價 37.74, 故其個股績效=12%, 且以後各期之績效皆為 12%, 將不再重新計算。

$$\text{投資績效 } Portfolio_1 = \frac{1}{10} \times (12\% + (-5.23\%) + (-16.24\%) + \dots + (-8.78\%) + 12\%) = 0.07\%$$

第2期,  $h=2$

AXP US 因該股期末收盤價 35.69 超過發行日之收盤價 27.92, 故其個股績效=12%, 且以後各期之績效皆為 12%, 將不再重新計算。

BAC US 因該股期末收盤價 82.25 超過發行日之收盤價 71.19, 故其個股績效=12%, 且以後各期之績效皆

為 12%，將不再重新計算。

...

KO US 因該股期末收盤價 83.44 超過發行日之收盤價 69.13，故其個股績效=12%，且以後各期之績效皆為 12%，將不再重新計算。

$$\text{投資績效 } Portfolio_2 = \frac{1}{10} \times (12\% + 12\% + 12\% + (-1.93\%) + \dots + 12\% + 12\%) = 10.61\%$$

第 3 期， $h = 3$

DOW US 因該股期末收盤價 29.50 未超過發行日之收盤價 31.67，故其個股績效 $= (29.50/31.67) - 1 = -6.85\%$

$$\text{投資績效 } Portfolio_3 = \frac{1}{10} \times (12\% + 12\% + 12\% + (-6.85\%) + \dots + 12\% + 12\%) = 10.12\%$$

第 4 期及以後， $h = 4, 5, \dots, 12$

DOW US 因該股期末收盤價 40.33 超過發行日之收盤價 31.67，故其個股績效=12%，且以後各期之績效皆為 12%，將不再重新計算。

$$\text{投資績效 } Portfolio_4 = \frac{1}{10} \times (12\% + 12\% + 12\% + 12\% + \dots + 12\% + 12\%) = 12\%$$

【說明】各期收益分配及「結構型債券到期金」計算步驟如下：

● 第 1 期， $h = 1$

$$R_1 = \text{Max} (0\%, 4\% + 2\% \times Portfolio_1) = \text{Max} (0, 4.00\%) \\ = 4.00\%$$

$$\text{收益分配} = 10000 \text{ 美元} \times 4.00\% = 400 \text{ 美元}$$

● 第 2 期， $h = 2$

$$R_2 = \text{Max} (0\%, 4\% + 2\% \times Portfolio_2) = \text{Max} (0, 4.21\%) \\ = 4.21\%$$

$$\text{收益分配} = 10000 \text{ 美元} \times 4.21\% = 421 \text{ 美元}$$

● 第 3 期， $h = 3$

$$R_3 = \text{Max} (0\%, 4\% + 2\% \times Portfolio_3) = \text{Max} (0, 4.20\%) \\ = 4.20\%$$

$$\text{收益分配} = 10000 \text{ 美元} \times 4.20\% = 420 \text{ 美元}$$

.....

● 第 12 期， $h = 12$

$$R_{12} = \text{Max} (0\%, 4\% + 2\% \times Portfolio_{12}) = \text{Max} (0, 4.24\%) \\ = 4.24\%$$

$$\text{收益分配} = 10000 \text{ 美元} \times 4.24\% = 424 \text{ 美元}$$

「結構型債券到期金」計算步驟如下：

「結構型債券到期金」 = 「結構型債券淨投資金額」 = 10,000 美元

『第三種計算公式』

「結構型債券到期金」 = 「結構型債券淨投資金額」 × [ 1 + Max ( 投資組合成長率 × 參與率, 最低保證投資報酬率 ) ]

其中：

- 一、「參與率」及「最低保證投資報酬率」隨結構型債券之不同而不同，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。
- 二、投資組合成長率公式：

$$\text{投資組合成長率} = \sum_{h=1}^T W_h \times \text{Portfolio}_h$$

其中：

第  $h$  期之投資績效 ( $\text{Portfolio}_h$ ) 計算公式如下：

1.  $h = 1$  (第 1 期)：連結之  $N$  個標的中，於第 1 期期末選出成長率最高之連結標的，而第 1 期之投資績效即為該連結標的之成長率。
2.  $h = 2, 3, \dots, T$  (第 2 期及以後)：連結之  $N$  個標的中，剔除前  $h-1$  期選出之連結標的後，剩餘之  $N - h + 1$  個連結標的於第  $h$  期期末選出成長率最高之連結標的，而第  $h$  期之投資績效即為該連結標的之成長率。

$$\text{其中第 } n \text{ 個連結標的之成長率} = \left[ \frac{\text{Underlying}_n^h - \text{Underlying}_n^0}{\text{Underlying}_n^0} \right]$$

$$T : \text{「結構型債券投資期間」總期數, } T = \sum_{i=1}^H M_i。$$

$H$ ：結構型債券之投資期間（年數）。

$M_i$ ：第  $i$  年度中之期數， $M_i = 12 / t_{mi}$ 。

$t_{mi}$ ：第  $i$  年度中每一期期間之月數（於每次銷售結構型債券時決定，可能為 1 個月、2 個月、3 個月、6 個月或 12 個月）。

第  $h$  期：係指自「結構型債券發行日」起以每  $t_{mi}$  個月為一期之週期；例如，假設每年以 12 個月為一期 ( $t_{mi} = 12, M_i = 1$ )，而 2007/12/11 為「結構型債券發行日」，則第 1 期之期間為 2007/12/11 至 2008/12/10，第 2 期之期間為 2008/12/11 至 2009/12/10，第 3 期之期間為 2009/12/11 至 2010/12/10，以此類推。但每一期之期初及期末需為結構型債券評價日，若非結構型債券評價日時則需遞延至次一結構型債券評價日。

結構型債券評價日：係指該結構型債券所連結之標的所屬報價市場共同之營業日。

$\text{Portfolio}_h$ ：第  $h$  期之投資績效。

$N$ ：連結之標的個數。

$$W_h : \text{第 } h \text{ 期投資績效所佔之權重, } \sum_{h=1}^T W_h = 1。$$

$\text{Underlying}_n^0$ ：第  $n$  個連結標的於「結構型債券發行日」之收盤值。

$\text{Underlying}_n^h$ ：第  $n$  個連結標的於第  $h$  期期末前  $dh$  個結構型債券評價日之收盤值。

$dh$ ：此參數為固定數值，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

### 三、範例說明

(本範例說明僅為使要保人更加了解「結構型債券到期金」之計算方式，其引用數字僅做參考，不代表未來實際情況。)

#### 【假設】

1. 1997 年 3 月 31 日為投入 6 年期 ( $H = 6$ ) 結構型債券之發行日，「結構型債券淨投資金額」為 10,000 美元；
2. 自「結構型債券發行日」起每 6 個月為一週期 ( $t_{mi} = 6, M_i = 12 / t_{mi} = 12 / 6 = 2, T = \sum_{i=1}^H M_i = \sum_{i=1}^6 2 = 12$ )；
3. 連結之標的為 15 支股票 ( $N = 15$ )，各期之投資績效權重皆相同 ( $W_1 = W_2 = \dots = W_{12} = 1 / 12$ )；

4.參與率為 65%，最低保證投資報酬率為 23%， $dh=0$ ；

5.連結標的之各期期初及期末收盤值如下：

| 期數<br>$h$     | 期末日期       | MO<br>US | T<br>US | BLS<br>US | BMJ<br>US | 7751<br>JP | DOW<br>US | EOA<br>GR | 7267<br>JP | LLOY<br>LN | MRK<br>US | NESN<br>VX | PRU<br>LN | RDEN<br>US | SGP<br>US | 7203<br>JP |
|---------------|------------|----------|---------|-----------|-----------|------------|-----------|-----------|------------|------------|-----------|------------|-----------|------------|-----------|------------|
| 「結構型債券發行日」收盤值 |            |          |         |           |           |            |           |           |            |            |           |            |           |            |           |            |
| 0             | 1997/03/31 | 38.04    | 37.02   | 21.06     | 28.08     | 2650       | 26.63     | 48.27     | 3690       | 499.50     | 39.87     | 168.50     | 567.00    | 38.64      | 26.25     | 3130       |
| 每期期末收盤值       |            |          |         |           |           |            |           |           |            |            |           |            |           |            |           |            |
| 1             | 1997/09/30 | 41.56    | 46.97   | 23.13     | 39.38     | 3530       | 30.23     | 52.00     | 4210       | 834.50     | 47.29     | 202.60     | 690.50    | 50.55      | 30.72     | 3700       |
| 2             | 1998/03/31 | 41.69    | 69.80   | 33.72     | 49.64     | 3010       | 32.42     | 65.96     | 4800       | 929.00     | 60.66     | 291.30     | 878.00    | 53.55      | 43.37     | 3550       |
| 3             | 1998/09/30 | 46.25    | 62.03   | 37.63     | 49.43     | 2770       | 28.48     | 44.36     | 4150       | 659.00     | 61.31     | 275.40     | 860.00    | 42.43      | 44.38     | 3050       |
| 4             | 1999/03/31 | 35.19    | 84.72   | 40.06     | 61.03     | 2930       | 31.06     | 48.65     | 5350       | 937.00     | 75.83     | 268.90     | 807.50    | 49.25      | 47.19     | 3430       |
| 5             | 1999/09/30 | 34.19    | 69.26   | 45.00     | 64.24     | 3100       | 37.88     | 51.40     | 4460       | 755.00     | 61.34     | 282.00     | 933.00    | 54.50      | 51.06     | 3390       |
| 6             | 2000/03/31 | 20.75    | 89.67   | 46.88     | 54.37     | 4450       | 38.00     | 53.36     | 4240       | 662.00     | 58.80     | 298.00     | 946.50    | 61.01      | 42.13     | 5370       |
| 7             | 2000/10/02 | 29.44    | 46.18   | 40.50     | 54.73     | 4790       | 24.94     | 58.40     | 3980       | 631.00     | 70.45     | 360.00     | 923.00    | 68.49      | 49.88     | 4270       |
| 8             | 2001/04/02 | 47.45    | 33.92   | 40.92     | 56.54     | 4550       | 31.57     | 54.10     | 5120       | 691.50     | 71.84     | 361.70     | 752.50    | 62.99      | 44.63     | 4350       |
| 9             | 2001/10/01 | 48.29    | 39.57   | 41.55     | 55.56     | 3270       | 32.76     | 56.89     | 3870       | 650.00     | 63.03     | 345.00     | 700.00    | 55.22      | 47.12     | 3060       |
| 10            | 2002/04/01 | 52.67    | 32.19   | 36.86     | 40.49     | 4720       | 32.72     | 58.35     | 5380       | 721.00     | 54.50     | 374.00     | 708.00    | 62.75      | 37.44     | 3650       |
| 11            | 2002/09/30 | 38.80    | 24.62   | 18.36     | 23.80     | 3980       | 27.31     | 47.80     | 4930       | 469.50     | 43.26     | 322.00     | 339.50    | 40.85      | 20.10     | 3130       |
| 12            | 2003/03/31 | 29.96    | 16.20   | 21.67     | 21.13     | 4140       | 27.61     | 37.78     | 3950       | 322.00     | 51.85     | 267.50     | 308.50    | 37.31      | 20.06     | 2635       |

【說明】各期投資績效及「結構型債券到期金」計算步驟如下：

各期投資績效計算步驟如下：

| 期數<br>$h$ | MO<br>US | T<br>US | BLS<br>US | BMJ<br>US | 7751<br>JP | DOW<br>US | EOA<br>GR | 7267<br>JP | LLOY<br>LN | MRK<br>US | NESN<br>VX | PRU<br>LN | RDEN<br>US | SGP<br>US | 7203<br>JP | 投資績效<br>$Portfolio_h$ |
|-----------|----------|---------|-----------|-----------|------------|-----------|-----------|------------|------------|-----------|------------|-----------|------------|-----------|------------|-----------------------|
| 1         | 9.25%    | 26.88%  | 9.83%     | 40.24%    | 33.21%     | 13.52%    | 7.73%     | 14.09%     | 67.07%     | 18.61%    | 20.24%     | 21.78%    | 30.82%     | 17.03%    | 18.21%     | 67.07%                |
| 2         | 9.60%    | 88.55%  | 60.11%    | 76.78%    | 13.58%     | 21.74%    | 36.65%    | 30.08%     |            | 52.14%    | 72.88%     | 54.85%    | 38.59%     | 65.22%    | 13.42%     | 88.55%                |
| 3         | 21.58%   |         | 78.68%    | 76.03%    | 4.53%      | 6.95%     | -8.10%    | 12.47%     |            | 53.77%    | 63.44%     | 51.68%    | 9.81%      | 69.07%    | -2.56%     | 78.68%                |
| 4         | -7.49%   |         |           | 117.34%   | 10.57%     | 16.64%    | 0.79%     | 44.99%     |            | 90.19%    | 59.58%     | 42.42%    | 27.46%     | 79.77%    | 9.58%      | 117.34%               |
| 5         | -10.12%  |         |           |           | 16.98%     | 42.25%    | 6.48%     | 20.87%     |            | 53.85%    | 67.36%     | 64.55%    | 41.05%     | 94.51%    | 8.31%      | 94.51%                |
| 6         | -45.45%  |         |           |           | 67.92%     | 42.70%    | 10.54%    | 14.91%     |            | 47.48%    | 76.85%     | 66.93%    | 57.89%     |           | 71.57%     | 76.85%                |
| 7         | -22.61%  |         |           |           | 80.75%     | -6.35%    | 20.99%    | 7.86%      |            | 76.70%    |            | 62.79%    | 77.25%     |           | 36.42%     | 80.75%                |
| 8         | 24.74%   |         |           |           |            | 18.55%    | 12.08%    | 38.75%     |            | 80.19%    |            | 32.72%    | 63.02%     |           | 38.98%     | 80.19%                |
| 9         | 26.95%   |         |           |           |            | 23.02%    | 17.86%    | 4.88%      |            |           |            | 23.46%    | 42.91%     |           | -2.24%     | 42.91%                |
| 10        | 38.46%   |         |           |           |            | 22.87%    | 20.88%    | 45.80%     |            |           |            | 24.87%    |            |           | 16.61%     | 45.80%                |
| 11        | 2.00%    |         |           |           |            | 2.55%     | -0.97%    |            |            |           |            | -40.12%   |            |           | 0.00%      | 2.55%                 |
| 12        | -21.24%  |         |           |           |            |           | -21.73%   |            |            |           |            | -45.59%   |            |           | -15.81%    | -15.81%               |

●第 0.5 年 ( $h=1$ )

MO US 之成長率 =  $41.56 / 38.04 - 1 = 9.25\%$ ，T US 之成長率 =  $46.97 / 37.02 - 1 = 26.88\%$ ，...，  
SGP US 之成長率 =  $30.72 / 26.25 - 1 = 17.03\%$ ，7203 JP 之成長率 =  $3700 / 3130 - 1 = 18.21\%$   
 $Portfolio_1 = 15$  支股票成長率之最大值 =  $\text{Max}(9.25\%, 26.87\%, \dots, 17.03\%, 18.21\%) = 67.07\%$

●第 1 年 ( $h=2$ )

MO US 之成長率 =  $41.69 / 38.04 - 1 = 9.60\%$ ，T US 之成長率 =  $69.80 / 37.02 - 1 = 88.55\%$ ，...，  
SGP US 之成長率 =  $43.37 / 26.25 - 1 = 65.22\%$ ，7203 JP 之成長率 =  $3550 / 3130 - 1 = 13.42\%$   
 $Portfolio_2 = 14$  支股票成長率之最大值 =  $\text{Max}(9.60\%, 88.55\%, \dots, 65.22\%, 13.42\%) = 88.55\%$

●第 1.5 年 ( $h=3$ )

MO US 之成長率 =  $46.25 / 38.04 - 1 = 21.58\%$ ，BLS US 之成長率 =  $37.63 / 21.06 - 1 = 78.68\%$ ，...，  
SGP US 之成長率 =  $44.38 / 26.25 - 1 = 69.07\%$ ，7203 JP 之成長率 =  $3050 / 3130 - 1 = -2.56\%$   
 $Portfolio_3 = 13$  支股票成長率之最大值 =  $\text{Max}(21.58\%, 78.68\%, \dots, 69.07\%, -2.56\%) = 78.68\%$

...

●第 5.5 年 ( $h=11$ )

MO US 之成長率 =  $38.80 / 38.04 - 1 = 2.00\%$ ，DOW US 之成長率 =  $27.31 / 26.63 - 1 = 2.55\%$ ，  
EOA GR 之成長率 =  $47.80 / 48.27 - 1 = -0.97\%$ ，PRU LN 之成長率 =  $339.50 / 567.00 - 1 = -40.12\%$ ，  
7203 JP 之成長率 =  $3130 / 3130 - 1 = 0.00\%$   
 $Portfolio_{11} = 5$  支股票成長率之最大值 =  $\text{Max}(2.00\%, 2.55\%, -0.97\%, -40.12\%, 0.00\%) = 2.55\%$

●第 6 年 ( $h=12$ )

MO US 之成長率 =  $29.96 / 38.04 - 1 = -21.24\%$ ，EOA GR 之成長率 =  $37.78 / 48.27 - 1 = -21.73\%$ ，  
PRU LN 之成長率 =  $308.50 / 567.00 - 1 = -45.59\%$ ，7203 JP 之成長率 =  $2635 / 3130 - 1 = -15.81\%$   
 $Portfolio_{12} = 4$  支股票成長率之最大值 =  $\text{Max}(-21.24\%, -21.73\%, -45.59\%, -15.81\%) = -15.81\%$

「結構型債券到期金」計算步驟如下：

$$\begin{aligned} \text{投資組合成長率} &= \sum_{h=1}^{12} W_h \times \text{Portfolio}_h = [67.07\% + 88.55\% + 78.68\% + \dots + 2.55\% + (-15.81\%)] / 12 \\ &= 63.28\% \end{aligned}$$

「結構型債券到期金」=「結構型債券淨投資金額」×[1+Max(投資組合成長率×參與率, 最低保證投資報酬率)]

$$= 10,000 \text{ 美元} \times [1 + \text{Max}(63.28\% \times 65\%, 23\%)]$$

$$= 10,000 \text{ 美元} \times [1 + \text{Max}(41.13\%, 23\%)] = 14,113 \text{ 美元}$$

『第四種計算公式』

$$\text{「結構型債券到期金」} = \text{「結構型債券淨投資金額」} \times \left(1 + \sum_{h=1}^T CP_h\right)$$

其中：

一、 $CP_h = \text{Max}(EC_h, X_h)$

$$X_h = \begin{cases} A, & h=1 \\ CP_{h-1}, & h=2 \sim T \end{cases}$$

$EC_h = (\text{參與率} \times \text{投資組合成長率}), h=1 \sim T$

$\text{投資組合成長率} = \text{Min}[| \text{Return}(\text{Index}_{1,h}) |, | \text{Return}(\text{Index}_{2,h}) |, \dots, | \text{Return}(\text{Index}_{N,h}) |]$

即

$\text{Min}[| \text{Return}(\text{Index}_{1,1}) |, | \text{Return}(\text{Index}_{2,1}) |, \dots, | \text{Return}(\text{Index}_{N,1}) |], h=1$  第1期

$\text{Min}[| \text{Return}(\text{Index}_{1,2}) |, | \text{Return}(\text{Index}_{2,2}) |, \dots, | \text{Return}(\text{Index}_{N,2}) |], h=2$  第2期

...

$\text{Min}[| \text{Return}(\text{Index}_{1,T}) |, | \text{Return}(\text{Index}_{2,T}) |, \dots, | \text{Return}(\text{Index}_{N,T}) |], h=T$  第T期

$| \text{Return}(\text{Index}_{i,h}) |$ ：第*i*個連結標的在第*h*期期末相對第*h-1*期期末之報酬率絕對值。

$$\text{Return}(\text{Index}_{i,h}) = \frac{\text{Index}_{i,h}}{\text{Index}_{i,h-1}} - 1, i=1,2,\dots,N \quad h=1,2,\dots,T$$

$T$ ：「結構型債券投資期間」總期數， $T = \sum_{i=1}^H M_i$ 。

$H$ ：結構型債券之投資期間（年數）。

$M_i$ ：第*i*年度中之期數， $M_i = 12 / t_{mi}$ 。

$t_{mi}$ ：第*i*年度中每一期期間之月數（於每次銷售結構型債券時決定，可能為1個月、2個月、3個月、6個月或12個月）。

第*h*期：係指自「結構型債券發行日」起以每  $t_{mi}$  個月為一期之週期；例如，假設每年以12個月為一期（ $t_{mi} = 12, M_i = 1$ ），而2007/12/11為「結構型債券發行日」，則第1期之期間為2007/12/11至2008/12/10，第2期之期間為2008/12/11至2009/12/10，第3期之期間為2009/12/11至2010/12/10，以此類推。但每一期之期初及期末需為結構型債券評價日，若非結構型債券評價日時則需遞延至次一結構型債券評價日。

結構型債券評價日：係指該結構型債券所連結之標的所屬報價市場共同之營業日。

$A$ 及「參與率」：隨結構型債券之不同而不同，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$N$ ：連結之標的個數。

二、範例說明

（本範例說明僅為使要保人更加了解「結構型債券到期金」之計算方式，其引用數字僅做參考，不代表未來實際情況。）

【假設】

1.1997年12月30日為投入6年期（ $H=6$ ）結構型債券之發行日，「結構型債券淨投資金額」為10,000美元；

2.連結之標的為S&P500指數及恆生指數（ $N=2$ ）；

3.自「結構型債券發行日」起每一年為一週期（ $t_{mi} = 12, M_i = 12 / t_{mi} = 12 / 12 = 1, T = \sum_{i=1}^H M_i = \sum_{i=1}^6 1 = 6$ ）；

4. $A = 3\%$ 、參與率 = 20%；

5.連結標的之各期期初及期末收盤值如下：

| 期數<br>$h$ | 指數部分       |           |          |
|-----------|------------|-----------|----------|
|           | 期末日期       | S&P500 指數 | 恆生指數     |
| 0         | 1997/12/30 | 970.84    | 13722.70 |
| 1         | 1998/12/30 | 1231.93   | 13739.07 |

| 期數<br>$h$ | 指數部分       |           |          |
|-----------|------------|-----------|----------|
|           | 期末日期       | S&P500 指數 | 恆生指數     |
| 2         | 1999/12/30 | 1464.47   | 11581.58 |
| 3         | 2001/01/02 | 1283.27   | 9510.62  |
| 4         | 2001/12/31 | 1148.08   | 12116.87 |
| 5         | 2002/12/30 | 879.39    | 13714.78 |
| 6         | 2003/12/30 | 1109.64   | 13722.70 |

【說明】各期投資組合成長率及「結構型債券到期金」計算步驟如下：

| 期數 $h$ | $Return( Index_{1,h} )$ | $Return( Index_{2,h} )$ | 投資組合成長率 | $EC_h$ | $X_h$ | $CP_h$ |
|--------|-------------------------|-------------------------|---------|--------|-------|--------|
| 1      | 26.89%                  | 0.12%                   | 0.12%   | 0.024% | 3.00% | 3.00%  |
| 2      | 18.88%                  | -15.70%                 | 15.70%  | 3.140% | 3.00% | 3.14%  |
| 3      | -12.37%                 | -17.88%                 | 12.37%  | 2.474% | 3.14% | 3.14%  |
| 4      | -10.53%                 | 27.40%                  | 10.53%  | 2.106% | 3.14% | 3.14%  |
| 5      | -23.40%                 | 13.19%                  | 13.19%  | 2.638% | 3.14% | 3.14%  |
| 6      | 26.18%                  | 0.06%                   | 0.06%   | 0.012% | 3.14% | 3.14%  |

各期投資組合成長率計算步驟如下：

●第 1 年 ( $h=1$ )

$$\begin{aligned} \text{投資組合成長率} &= \text{Min}[ |Return( Index_{1,1} )| , |Return( Index_{2,1} )| \\ &= \text{Min}[ |1231.93 / 970.84 - 1| , |13739.07 / 13722.70 - 1| ] \\ &= \text{Min}[ |26.89\%| , |0.12\%| ] = 0.12\% \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} CP_1 &= \text{Max}( EC_1, X_1 ) = \text{Max}( \text{參與率} \times \text{投資組合成長率}, A ) \\ &= \text{Max}( 20\% \times 0.12\%, 3.00\% ) = \text{Max}( 0.024\%, 3.00\% ) \\ &= 3.00\% \end{aligned}$$

●第 2 年 ( $h=2$ )

$$\begin{aligned} \text{投資組合成長率} &= \text{Min}[ |Return( Index_{1,2} )| , |Return( Index_{2,2} )| \\ &= \text{Min}[ |1464.47 / 1231.93 - 1| , |11581.58 / 13739.07 - 1| ] \\ &= \text{Min}[ |18.88\%| , |-15.70\%| ] = 15.70\% \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} CP_2 &= \text{Max}( EC_2, X_2 ) = \text{Max}( \text{參與率} \times \text{投資組合成長率}, CP_1 ) \\ &= \text{Max}( 20\% \times 15.70\%, 3.00\% ) = \text{Max}( 3.140\%, 3.00\% ) \\ &= 3.14\% \end{aligned}$$

...

●第 6 年 ( $h=6$ )

$$\begin{aligned} \text{投資組合成長率} &= \text{Min}[ |Return( Index_{1,6} )| , |Return( Index_{2,6} )| \\ &= \text{Min}[ |1109.64 / 879.39 - 1| , |13722.70 / 13714.78 - 1| ] \\ &= \text{Min}[ |26.18\%| , |0.06\%| ] = 0.06\% \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} CP_6 &= \text{Max}( EC_6, X_6 ) = \text{Max}( \text{參與率} \times \text{投資組合成長率}, CP_5 ) \\ &= \text{Max}( 20\% \times 0.06\%, 3.14\% ) = \text{Max}( 0.012\%, 3.14\% ) \\ &= 3.14\% \end{aligned}$$

「結構型債券到期金」計算步驟如下：

$$\begin{aligned} \text{「結構型債券到期金」} &= \text{「結構型債券淨投資金額」} \times \left( 1 + \sum_{h=1}^T CP_h \right) \\ &= 10,000 \text{ 美元} \times [ 1 + 3.00\% + 3.14\% + 3.14\% + 3.14\% + 3.14\% + 3.14\% ] \\ &= 11,870 \text{ 美元} \end{aligned}$$

『第五種計算公式』

「結構型債券到期金」=「結構型債券淨投資金額」

每一期期末依配息公式分配收益並依條款第十條之約定方式分配

一、配息公式：第  $h$  期之收益分配 = 「結構型債券淨投資金額」 $\times$  第  $h$  期之收益分配率

其中，

1. 第  $h$  期之收益分配率 ( $R_h$ ) 之計算公式如下：

$$R_h = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ A_h + (B_h + PR_h \times \text{Portfolio}_h) \times \frac{g_h}{G_h}, \text{Floor}_h \right], \text{Cap}_h \right\}$$

2. 額外收益分配率：於「結構型債券到期日」除給付「結構型債券到期金」及當期收益分配率  $R_T$  外，另加發額外收益分配率  $ED_T$ 。

其中

$$T : \text{「結構型債券投資期間」總期數}, T = \sum_{i=1}^H M_i$$

$H$  : 結構型債券之投資期間 (年數)。

$M_i$  : 第  $i$  年度中之期數,  $M_i = 12 / t_{mi}$ 。

$t_{mi}$  : 第  $i$  年度中每一期期間之月數 (於每次銷售結構型債券時決定, 可能為 1 個月、2 個月、3 個月、6 個月或 12 個月)。

$\text{Portfolio}_h$  : 第  $h$  期之投資績效, 其計算公式如右:  $\text{Portfolio}_h = C_h \% \times [X]IR_h - D_h \% \times [Y]IR_h$

$IR$  : 本結構型債券所連結之指標, 可能為利率、即期匯價或股價指數, 於每次銷售結構型債券時決定; 本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$[X]IR_h$  : 指連結指標於第  $h$  期期末前  $dh$  個評價日 (即第  $h$  觀察期期末) 報價之結構型債券幣別之  $X$  年期結算值。

$[Y]IR_h$  : 指連結指標於第  $h$  期期末前  $dh$  個評價日 (即第  $h$  觀察期期末) 報價之結構型債券幣別之  $Y$  年期結算值。

$dh$  : 此參數為固定數值, 於每次銷售結構型債券時決定, 本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

第  $h$  期 : 係指自「結構型債券發行日」起以每  $t_{mi}$  個月為一期之週期; 例如, 假設每 6 個月為一期 ( $t_{mi} = 6, M_i = 2$ ), 而 2007/7/3 為「結構型債券發行日」, 則第一期之期間為 2007/7/3 至 2008/1/2, 第二期之期間為 2008/1/3 至 2008/7/2, 第三期之期間為 2008/7/3 至 2009/1/2, 以此類推; 但每一期之期初及期末需為結構型債券評價日, 若非結構型債券評價日時則需遞延至次一結構型債券評價日。

結構型債券評價日 : 係指該結構型債券所連結之標的所屬報價市場共同之營業日。

$g_h$  : 第  $h$  觀察期期間內,  $\text{Spread}_h^d$  落在規定區間  $\text{Barrier}_h$  內之日數合計。

$G_h$  : 第  $h$  觀察期期間內, 計算參考指標之日數總計。

$$\text{Spread}_h^d = C_h \% \times [X]IR_h^d - D_h \% \times [Y]IR_h^d$$

$\text{Barrier}_h$  : 第  $h$  觀察期之規定區間, 於每次銷售結構型債券時決定; 本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$[X]IR_h^d$  : 指連結指標於第  $h$  觀察期第  $d$  個評價日報價之  $X$  年期結算值。

$[Y]IR_h^d$  : 指連結指標於第  $h$  觀察期第  $d$  個評價日報價之  $Y$  年期結算值。

$A_h, B_h, C_h, D_h, PR_h, \text{Floor}_h, \text{Cap}_h$  : 此七組參數為計算配息之因子, 於每次銷售結構型債券時決定, 本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$ED_T$  : 額外收益分配率, 於每次銷售結構型債券時決定, 本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

二、範例說明

(本範例說明僅為使要保人更加了解「結構型債券到期金」及配息之計算方式, 其引用數字僅做參考, 不代表未來實際情況。)

【假設】

1. 1997 年 8 月 1 日為投入 7 年期 ( $H=7$ ) 結構型債券之發行日, 「結構型債券淨投資金額」為 10,000 美元;

2. 自「結構型債券發行日」起每 12 個月為一週期 ( $t_{mi}=12, M_i=12/t_{mi}=12/12=1, T=\sum_{i=1}^H M_i = \sum_{i=1}^7 1 = 7$ );

3.連結之標的為固定期限交換利率(Constant Maturity Swap, CMS)， $IR=CMS$ ；

4. $A_h=0\%$ ， $B_h=7\%$ ， $C_h=100\%$ ， $D_h=100\%$ ， $PR_h=100\%$ ， $Floor_h=1\%$ ， $Cap_h=10\%$ ， $dh=5$ ， $X=10$ ， $Y=2$ ；

5.額外收益分配率：於「結構型債券到期日」加發 8%（即  $ED_T=8\%$ ）。

6.每一觀察期之 $[10]CMS_h$ 、 $[2]CMS_h$ 、規定區間  $Barrier_h$  之資料如下表，則各期投資績效經計算如下：

| 期數<br>$h$ | 期末日期     | 第 $h$ 觀察期期末日<br>(期末前 5 個<br>結構型債券評價日) | 規定區間<br>$Barrier_h$ | $[10]CMS_h$ | $[2]CMS_h$ | 投資績效<br>$Portfolio_h$ |
|-----------|----------|---------------------------------------|---------------------|-------------|------------|-----------------------|
| 1         | 1998/8/3 | 1998/7/27                             | 0%~0.50%            | 6.03%       | 5.85%      | 0.18%                 |
| 2         | 1999/8/2 | 1999/7/26                             | 0%~0.75%            | 6.84%       | 6.16%      | 0.68%                 |
| 3         | 2000/8/1 | 2000/7/25                             | 0%~1.00%            | 7.23%       | 7.07%      | 0.16%                 |
| 4         | 2001/8/1 | 2001/7/25                             | 0%~1.50%            | 5.99%       | 4.51%      | 1.48%                 |
| 5         | 2002/8/1 | 2002/7/25                             | 0%~2.00%            | 5.01%       | 2.68%      | 2.33%                 |
| 6         | 2003/8/1 | 2003/7/25                             | 0%~2.00%            | 4.60%       | 1.71%      | 2.89%                 |
| 7         | 2004/8/2 | 2004/7/26                             | 0%~1.00%            | 4.98%       | 3.16%      | 1.82%                 |

計算說明：

第 1 期之投資績效  $Portfolio_1 = [10]CMS_1 - [2]CMS_1 = 6.03\% - 5.85\% = 0.18\%$

第 2 期之投資績效  $Portfolio_2 = [10]CMS_2 - [2]CMS_2 = 6.84\% - 6.16\% = 0.68\%$

第 3 期之投資績效  $Portfolio_3 = [10]CMS_3 - [2]CMS_3 = 7.23\% - 7.07\% = 0.16\%$

...

以下類推。

【說明】各期收益分配及「結構型債券到期金」計算步驟如下：

- 第 1 期期間（1997/8/1~1998/7/31）， $h = 1$

假設第 1 觀察期（1997/8/1~1998/7/31）之 $[10]CMS_1^d$ 、 $[2]CMS_1^d$  及兩者差異  $Spread_1^d$  每日變化如下表：

| d  | 評價日       | $[10]CMS_1^d$ | $[2]CMS_1^d$ | $Spread_1^d$ | d   | 評價日        | $[10]CMS_1^d$ | $[2]CMS_1^d$ | $Spread_1^d$ | d   | 評價日       | $[10]CMS_1^d$ | $[2]CMS_1^d$ | $Spread_1^d$ | d   | 評價日       | $[10]CMS_1^d$ | $[2]CMS_1^d$ | $Spread_1^d$ |
|----|-----------|---------------|--------------|--------------|-----|------------|---------------|--------------|--------------|-----|-----------|---------------|--------------|--------------|-----|-----------|---------------|--------------|--------------|
| 1  | 1997/8/1  | 6.59%         | 6.17%        | 0.42%        | 93  | 1997/11/1  | 6.37%         | 6.02%        | 0.35%        | 185 | 1998/2/1  | 5.99%         | 5.66%        | 0.33%        | 277 | 1998/5/4  | 6.16%         | 5.97%        | 0.19%        |
| 2  | 1997/8/2  | 6.59%         | 6.17%        | 0.42%        | 94  | 1997/11/2  | 6.37%         | 6.02%        | 0.35%        | 186 | 1998/2/2  | 6.05%         | 5.71%        | 0.34%        | 278 | 1998/5/5  | 6.21%         | 6.01%        | 0.20%        |
| 3  | 1997/8/3  | 6.59%         | 6.17%        | 0.42%        | 95  | 1997/11/3  | 6.42%         | 6.07%        | 0.35%        | 187 | 1998/2/3  | 6.02%         | 5.67%        | 0.35%        | 279 | 1998/5/6  | 6.16%         | 5.93%        | 0.23%        |
| 4  | 1997/8/4  | 6.62%         | 6.20%        | 0.42%        | 96  | 1997/11/4  | 6.46%         | 6.08%        | 0.38%        | 188 | 1998/2/4  | 6.01%         | 5.66%        | 0.35%        | 280 | 1998/5/7  | 6.18%         | 5.95%        | 0.23%        |
| 5  | 1997/8/5  | 6.64%         | 6.21%        | 0.43%        | 97  | 1997/11/5  | 6.41%         | 6.05%        | 0.36%        | 189 | 1998/2/5  | 6.10%         | 5.70%        | 0.40%        | 281 | 1998/5/8  | 6.20%         | 5.98%        | 0.22%        |
| 6  | 1997/8/6  | 6.62%         | 6.20%        | 0.42%        | 98  | 1997/11/6  | 6.38%         | 6.07%        | 0.31%        | 190 | 1998/2/6  | 6.08%         | 5.70%        | 0.38%        | 282 | 1998/5/9  | 6.20%         | 5.98%        | 0.22%        |
| 7  | 1997/8/7  | 6.66%         | 6.24%        | 0.42%        | 99  | 1997/11/7  | 6.42%         | 6.09%        | 0.33%        | 191 | 1998/2/7  | 6.08%         | 5.70%        | 0.38%        | 283 | 1998/5/10 | 6.20%         | 5.98%        | 0.22%        |
| 8  | 1997/8/8  | 6.79%         | 6.31%        | 0.48%        | 100 | 1997/11/8  | 6.42%         | 6.09%        | 0.33%        | 192 | 1998/2/8  | 6.08%         | 5.70%        | 0.38%        | 284 | 1998/5/11 | 6.25%         | 6.02%        | 0.23%        |
| 9  | 1997/8/9  | 6.79%         | 6.31%        | 0.48%        | 101 | 1997/11/9  | 6.42%         | 6.09%        | 0.33%        | 193 | 1998/2/9  | 6.11%         | 5.72%        | 0.39%        | 285 | 1998/5/12 | 6.20%         | 5.98%        | 0.22%        |
| 10 | 1997/8/10 | 6.79%         | 6.31%        | 0.48%        | 102 | 1997/11/10 | 6.41%         | 6.10%        | 0.31%        | 194 | 1998/2/10 | 6.08%         | 5.74%        | 0.34%        | 286 | 1998/5/13 | 6.15%         | 5.98%        | 0.17%        |
| 11 | 1997/8/11 | 6.78%         | 6.30%        | 0.48%        | 103 | 1997/11/11 | 6.41%         | 6.10%        | 0.31%        | 195 | 1998/2/11 | 6.03%         | 5.71%        | 0.32%        | 287 | 1998/5/14 | 6.20%         | 6.00%        | 0.20%        |
| 12 | 1997/8/12 | 6.83%         | 6.34%        | 0.49%        | 104 | 1997/11/12 | 6.36%         | 6.09%        | 0.27%        | 196 | 1998/2/12 | 6.01%         | 5.70%        | 0.31%        | 288 | 1998/5/15 | 6.21%         | 6.00%        | 0.21%        |
| 13 | 1997/8/13 | 6.77%         | 6.24%        | 0.53%        | 105 | 1997/11/13 | 6.36%         | 6.09%        | 0.27%        | 197 | 1998/2/13 | 5.99%         | 5.68%        | 0.31%        | 289 | 1998/5/16 | 6.21%         | 6.00%        | 0.21%        |
| 14 | 1997/8/14 | 6.69%         | 6.20%        | 0.49%        | 106 | 1997/11/14 | 6.37%         | 6.10%        | 0.27%        | 198 | 1998/2/14 | 5.99%         | 5.68%        | 0.31%        | 290 | 1998/5/17 | 6.21%         | 6.00%        | 0.21%        |
| 15 | 1997/8/15 | 6.67%         | 6.15%        | 0.52%        | 107 | 1997/11/15 | 6.37%         | 6.10%        | 0.27%        | 199 | 1998/2/15 | 5.99%         | 5.68%        | 0.31%        | 291 | 1998/5/18 | 6.18%         | 5.97%        | 0.21%        |
| 16 | 1997/8/16 | 6.67%         | 6.15%        | 0.52%        | 108 | 1997/11/16 | 6.37%         | 6.10%        | 0.27%        | 200 | 1998/2/16 | 5.99%         | 5.68%        | 0.31%        | 292 | 1998/5/19 | 6.18%         | 5.96%        | 0.22%        |
| 17 | 1997/8/17 | 6.67%         | 6.15%        | 0.52%        | 109 | 1997/11/17 | 6.32%         | 6.09%        | 0.23%        | 201 | 1998/2/17 | 5.95%         | 5.67%        | 0.28%        | 293 | 1998/5/20 | 6.13%         | 5.94%        | 0.19%        |
| 18 | 1997/8/18 | 6.66%         | 6.14%        | 0.52%        | 110 | 1997/11/18 | 6.34%         | 6.08%        | 0.26%        | 202 | 1998/2/18 | 5.98%         | 5.69%        | 0.29%        | 294 | 1998/5/21 | 6.17%         | 5.99%        | 0.18%        |
| 19 | 1997/8/19 | 6.65%         | 6.15%        | 0.50%        | 111 | 1997/11/19 | 6.30%         | 6.07%        | 0.23%        | 203 | 1998/2/19 | 6.00%         | 5.71%        | 0.29%        | 295 | 1998/5/22 | 6.17%         | 5.99%        | 0.18%        |
| 20 | 1997/8/20 | 6.68%         | 6.19%        | 0.49%        | 112 | 1997/11/20 | 6.33%         | 6.10%        | 0.23%        | 204 | 1998/2/20 | 6.03%         | 5.71%        | 0.32%        | 296 | 1998/5/23 | 6.17%         | 5.99%        | 0.18%        |
| 21 | 1997/8/21 | 6.76%         | 6.24%        | 0.52%        | 113 | 1997/11/21 | 6.29%         | 6.04%        | 0.25%        | 205 | 1998/2/21 | 6.03%         | 5.71%        | 0.32%        | 297 | 1998/5/24 | 6.17%         | 5.99%        | 0.18%        |
| 22 | 1997/8/22 | 6.79%         | 6.25%        | 0.54%        | 114 | 1997/11/22 | 6.29%         | 6.04%        | 0.25%        | 206 | 1998/2/22 | 6.03%         | 5.71%        | 0.32%        | 298 | 1998/5/25 | 6.17%         | 5.99%        | 0.18%        |
| 23 | 1997/8/23 | 6.79%         | 6.25%        | 0.54%        | 115 | 1997/11/23 | 6.29%         | 6.04%        | 0.25%        | 207 | 1998/2/23 | 6.06%         | 5.74%        | 0.32%        | 299 | 1998/5/26 | 6.10%         | 5.93%        | 0.17%        |
| 24 | 1997/8/24 | 6.79%         | 6.25%        | 0.54%        | 116 | 1997/11/24 | 6.32%         | 6.06%        | 0.26%        | 208 | 1998/2/24 | 6.13%         | 5.86%        | 0.27%        | 300 | 1998/5/27 | 6.12%         | 5.93%        | 0.19%        |
| 25 | 1997/8/25 | 6.82%         | 6.27%        | 0.55%        | 117 | 1997/11/25 | 6.30%         | 6.07%        | 0.23%        | 209 | 1998/2/25 | 6.09%         | 5.82%        | 0.27%        | 301 | 1998/5/28 | 6.11%         | 5.94%        | 0.17%        |
| 26 | 1997/8/26 | 6.77%         | 6.25%        | 0.52%        | 118 | 1997/11/26 | 6.31%         | 6.09%        | 0.22%        | 210 | 1998/2/26 | 6.13%         | 5.88%        | 0.25%        | 302 | 1998/5/29 | 6.09%         | 5.92%        | 0.17%        |
| 27 | 1997/8/27 | 6.79%         | 6.27%        | 0.52%        | 119 | 1997/11/27 | 6.31%         | 6.09%        | 0.22%        | 211 | 1998/2/27 | 6.11%         | 5.86%        | 0.25%        | 303 | 1998/5/30 | 6.09%         | 5.92%        | 0.17%        |
| 28 | 1997/8/28 | 6.73%         | 6.22%        | 0.51%        | 120 | 1997/11/28 | 6.33%         | 6.11%        | 0.22%        | 212 | 1998/2/28 | 6.11%         | 5.86%        | 0.25%        | 304 | 1998/5/31 | 6.09%         | 5.92%        | 0.17%        |
| 29 | 1997/8/29 | 6.77%         | 6.26%        | 0.51%        | 121 | 1997/11/29 | 6.33%         | 6.11%        | 0.22%        | 213 | 1998/3/1  | 6.11%         | 5.86%        | 0.25%        | 305 | 1998/6/1  | 6.07%         | 5.87%        | 0.20%        |
| 30 | 1997/8/30 | 6.77%         | 6.26%        | 0.51%        | 122 | 1997/11/30 | 6.33%         | 6.11%        | 0.22%        | 214 | 1998/3/2  | 6.18%         | 5.88%        | 0.30%        | 306 | 1998/6/2  | 6.08%         | 5.89%        | 0.19%        |
| 31 | 1997/8/31 | 6.77%         | 6.26%        | 0.51%        | 123 | 1997/12/1  | 6.31%         | 6.14%        | 0.17%        | 215 | 1998/3/3  | 6.26%         | 5.94%        | 0.32%        | 307 | 1998/6/3  | 6.08%         | 5.90%        | 0.18%        |
| 32 | 1997/9/1  | 6.77%         | 6.26%        | 0.51%        | 124 | 1997/12/2  | 6.31%         | 6.11%        | 0.20%        | 216 | 1998/3/4  | 6.21%         | 5.90%        | 0.31%        | 308 | 1998/6/4  | 6.13%         | 5.93%        | 0.20%        |
| 33 | 1997/9/2  | 6.71%         | 6.21%        | 0.50%        | 125 | 1997/12/3  | 6.28%         | 6.06%        | 0.22%        | 217 | 1998/3/5  | 6.26%         | 5.93%        | 0.33%        | 309 | 1998/6/5  | 6.11%         | 5.94%        | 0.17%        |
| 34 | 1997/9/3  | 6.75%         | 6.26%        | 0.49%        | 126 | 1997/12/4  | 6.29%         | 6.05%        | 0.24%        | 218 | 1998/3/6  | 6.19%         | 5.88%        | 0.31%        | 310 | 1998/6/6  | 6.11%         | 5.94%        | 0.17%        |
| 35 | 1997/9/4  | 6.76%         | 6.26%        | 0.50%        | 127 | 1997/12/5  | 6.36%         | 6.16%        | 0.20%        | 219 | 1998/3/7  | 6.19%         | 5.88%        | 0.31%        | 311 | 1998/6/7  | 6.11%         | 5.94%        | 0.17%        |
| 36 | 1997/9/5  | 6.77%         | 6.26%        | 0.51%        | 128 | 1997/12/6  | 6.36%         | 6.16%        | 0.20%        | 220 | 1998/3/8  | 6.19%         | 5.88%        | 0.31%        | 312 | 1998/6/8  | 6.10%         | 5.94%        | 0.16%        |

| d  | 評價日        | [1]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>t</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日        | [1]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>t</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [1]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>t</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [1]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>t</sub> <sup>d</sup> |
|----|------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 37 | 1997/9/6   | 6.77%                            | 6.26%                            | 0.51%                            | 129 | 1997/12/7  | 6.36%                            | 6.16%                            | 0.20%                            | 221 | 1998/3/9  | 6.14%                            | 5.87%                            | 0.27%                            | 313 | 1998/6/9  | 6.12%                            | 5.95%                            | 0.17%                            |
| 38 | 1997/9/7   | 6.77%                            | 6.26%                            | 0.51%                            | 130 | 1997/12/8  | 6.41%                            | 6.20%                            | 0.21%                            | 222 | 1998/3/10 | 6.14%                            | 5.86%                            | 0.28%                            | 314 | 1998/6/10 | 6.05%                            | 5.91%                            | 0.14%                            |
| 39 | 1997/9/8   | 6.74%                            | 6.26%                            | 0.48%                            | 131 | 1997/12/9  | 6.38%                            | 6.16%                            | 0.22%                            | 223 | 1998/3/11 | 6.13%                            | 5.87%                            | 0.26%                            | 315 | 1998/6/11 | 5.99%                            | 5.82%                            | 0.17%                            |
| 40 | 1997/9/9   | 6.75%                            | 6.26%                            | 0.49%                            | 132 | 1997/12/10 | 6.34%                            | 6.11%                            | 0.23%                            | 224 | 1998/3/12 | 6.07%                            | 5.82%                            | 0.25%                            | 316 | 1998/6/12 | 5.98%                            | 5.82%                            | 0.16%                            |
| 41 | 1997/9/10  | 6.78%                            | 6.29%                            | 0.49%                            | 133 | 1997/12/11 | 6.27%                            | 6.05%                            | 0.22%                            | 225 | 1998/3/13 | 6.09%                            | 5.84%                            | 0.25%                            | 317 | 1998/6/13 | 5.98%                            | 5.82%                            | 0.16%                            |
| 42 | 1997/9/11  | 6.81%                            | 6.31%                            | 0.50%                            | 134 | 1997/12/12 | 6.20%                            | 5.99%                            | 0.21%                            | 226 | 1998/3/14 | 6.09%                            | 5.84%                            | 0.25%                            | 318 | 1998/6/14 | 5.98%                            | 5.82%                            | 0.16%                            |
| 43 | 1997/9/12  | 6.70%                            | 6.22%                            | 0.48%                            | 135 | 1997/12/13 | 6.20%                            | 5.99%                            | 0.21%                            | 227 | 1998/3/15 | 6.09%                            | 5.84%                            | 0.25%                            | 319 | 1998/6/15 | 5.93%                            | 5.77%                            | 0.16%                            |
| 44 | 1997/9/13  | 6.70%                            | 6.22%                            | 0.48%                            | 136 | 1997/12/14 | 6.20%                            | 5.99%                            | 0.21%                            | 228 | 1998/3/16 | 6.05%                            | 5.82%                            | 0.23%                            | 320 | 1998/6/16 | 6.00%                            | 5.86%                            | 0.14%                            |
| 45 | 1997/9/14  | 6.70%                            | 6.22%                            | 0.48%                            | 137 | 1997/12/15 | 6.26%                            | 6.04%                            | 0.22%                            | 229 | 1998/3/17 | 6.08%                            | 5.86%                            | 0.22%                            | 321 | 1998/6/17 | 6.08%                            | 5.90%                            | 0.18%                            |
| 46 | 1997/9/15  | 6.71%                            | 6.22%                            | 0.49%                            | 138 | 1997/12/16 | 6.24%                            | 6.04%                            | 0.20%                            | 230 | 1998/3/18 | 6.07%                            | 5.84%                            | 0.23%                            | 322 | 1998/6/18 | 6.06%                            | 5.88%                            | 0.18%                            |
| 47 | 1997/9/16  | 6.52%                            | 6.11%                            | 0.41%                            | 139 | 1997/12/17 | 6.27%                            | 6.08%                            | 0.19%                            | 231 | 1998/3/19 | 6.08%                            | 5.85%                            | 0.23%                            | 323 | 1998/6/19 | 6.02%                            | 5.86%                            | 0.16%                            |
| 48 | 1997/9/17  | 6.53%                            | 6.10%                            | 0.43%                            | 140 | 1997/12/18 | 6.21%                            | 6.04%                            | 0.17%                            | 232 | 1998/3/20 | 6.06%                            | 5.86%                            | 0.20%                            | 324 | 1998/6/20 | 6.02%                            | 5.86%                            | 0.16%                            |
| 49 | 1997/9/18  | 6.56%                            | 6.14%                            | 0.42%                            | 141 | 1997/12/19 | 6.20%                            | 6.02%                            | 0.18%                            | 233 | 1998/3/21 | 6.06%                            | 5.86%                            | 0.20%                            | 325 | 1998/6/21 | 6.02%                            | 5.86%                            | 0.16%                            |
| 50 | 1997/9/19  | 6.53%                            | 6.12%                            | 0.41%                            | 142 | 1997/12/20 | 6.20%                            | 6.02%                            | 0.18%                            | 234 | 1998/3/22 | 6.06%                            | 5.86%                            | 0.20%                            | 326 | 1998/6/22 | 6.02%                            | 5.88%                            | 0.14%                            |
| 51 | 1997/9/20  | 6.53%                            | 6.12%                            | 0.41%                            | 143 | 1997/12/21 | 6.20%                            | 6.02%                            | 0.18%                            | 235 | 1998/3/23 | 6.07%                            | 5.87%                            | 0.20%                            | 327 | 1998/6/23 | 6.01%                            | 5.87%                            | 0.14%                            |
| 52 | 1997/9/21  | 6.53%                            | 6.12%                            | 0.41%                            | 144 | 1997/12/22 | 6.19%                            | 6.03%                            | 0.16%                            | 236 | 1998/3/24 | 6.08%                            | 5.87%                            | 0.21%                            | 328 | 1998/6/24 | 6.02%                            | 5.87%                            | 0.15%                            |
| 53 | 1997/9/22  | 6.50%                            | 6.11%                            | 0.39%                            | 145 | 1997/12/23 | 6.19%                            | 6.01%                            | 0.18%                            | 237 | 1998/3/25 | 6.15%                            | 5.93%                            | 0.22%                            | 329 | 1998/6/25 | 6.02%                            | 5.88%                            | 0.14%                            |
| 54 | 1997/9/23  | 6.52%                            | 6.14%                            | 0.38%                            | 146 | 1997/12/24 | 6.23%                            | 6.05%                            | 0.18%                            | 238 | 1998/3/26 | 6.19%                            | 5.98%                            | 0.21%                            | 330 | 1998/6/26 | 6.01%                            | 5.87%                            | 0.14%                            |
| 55 | 1997/9/24  | 6.48%                            | 6.10%                            | 0.38%                            | 147 | 1997/12/25 | 6.23%                            | 6.04%                            | 0.19%                            | 239 | 1998/3/27 | 6.20%                            | 6.00%                            | 0.20%                            | 331 | 1998/6/27 | 6.01%                            | 5.87%                            | 0.14%                            |
| 56 | 1997/9/25  | 6.56%                            | 6.18%                            | 0.38%                            | 148 | 1997/12/26 | 6.23%                            | 6.04%                            | 0.19%                            | 240 | 1998/3/28 | 6.20%                            | 6.00%                            | 0.20%                            | 332 | 1998/6/28 | 6.01%                            | 5.87%                            | 0.14%                            |
| 57 | 1997/9/26  | 6.54%                            | 6.15%                            | 0.39%                            | 149 | 1997/12/27 | 6.23%                            | 6.04%                            | 0.19%                            | 241 | 1998/3/29 | 6.20%                            | 6.00%                            | 0.20%                            | 333 | 1998/6/29 | 6.02%                            | 5.88%                            | 0.14%                            |
| 58 | 1997/9/27  | 6.54%                            | 6.15%                            | 0.39%                            | 150 | 1997/12/28 | 6.23%                            | 6.04%                            | 0.19%                            | 242 | 1998/3/30 | 6.22%                            | 5.99%                            | 0.23%                            | 334 | 1998/6/30 | 6.00%                            | 5.84%                            | 0.16%                            |
| 59 | 1997/9/28  | 6.54%                            | 6.15%                            | 0.39%                            | 151 | 1997/12/29 | 6.25%                            | 6.05%                            | 0.20%                            | 243 | 1998/3/31 | 6.17%                            | 5.95%                            | 0.22%                            | 335 | 1998/7/1  | 5.99%                            | 5.85%                            | 0.14%                            |
| 60 | 1997/9/29  | 6.56%                            | 6.16%                            | 0.40%                            | 152 | 1997/12/30 | 6.27%                            | 6.04%                            | 0.23%                            | 244 | 1998/4/1  | 6.10%                            | 5.94%                            | 0.16%                            | 336 | 1998/7/2  | 5.97%                            | 5.82%                            | 0.15%                            |
| 61 | 1997/9/30  | 6.55%                            | 6.16%                            | 0.39%                            | 153 | 1997/12/31 | 6.22%                            | 6.01%                            | 0.21%                            | 245 | 1998/4/2  | 6.08%                            | 5.90%                            | 0.18%                            | 337 | 1998/7/3  | 5.97%                            | 5.82%                            | 0.15%                            |
| 62 | 1997/10/1  | 6.48%                            | 6.11%                            | 0.37%                            | 154 | 1998/1/1   | 6.22%                            | 6.00%                            | 0.22%                            | 246 | 1998/4/3  | 6.01%                            | 5.82%                            | 0.19%                            | 338 | 1998/7/4  | 5.97%                            | 5.82%                            | 0.15%                            |
| 63 | 1997/10/2  | 6.45%                            | 6.09%                            | 0.37%                            | 155 | 1998/1/2   | 6.12%                            | 5.93%                            | 0.19%                            | 247 | 1998/4/4  | 6.01%                            | 5.82%                            | 0.19%                            | 339 | 1998/7/5  | 5.97%                            | 5.82%                            | 0.15%                            |
| 64 | 1997/10/3  | 6.40%                            | 6.01%                            | 0.39%                            | 156 | 1998/1/3   | 6.12%                            | 5.93%                            | 0.19%                            | 248 | 1998/4/5  | 6.01%                            | 5.82%                            | 0.19%                            | 340 | 1998/7/6  | 5.96%                            | 5.81%                            | 0.15%                            |
| 65 | 1997/10/4  | 6.40%                            | 6.01%                            | 0.39%                            | 157 | 1998/1/4   | 6.12%                            | 5.93%                            | 0.19%                            | 249 | 1998/4/6  | 6.04%                            | 5.83%                            | 0.21%                            | 341 | 1998/7/7  | 5.99%                            | 5.82%                            | 0.17%                            |
| 66 | 1997/10/5  | 6.40%                            | 6.01%                            | 0.39%                            | 158 | 1998/1/5   | 6.01%                            | 5.92%                            | 0.09%                            | 250 | 1998/4/7  | 6.06%                            | 5.84%                            | 0.22%                            | 342 | 1998/7/8  | 5.99%                            | 5.83%                            | 0.16%                            |
| 67 | 1997/10/6  | 6.42%                            | 6.01%                            | 0.41%                            | 159 | 1998/1/6   | 5.96%                            | 5.75%                            | 0.21%                            | 251 | 1998/4/8  | 6.11%                            | 5.86%                            | 0.25%                            | 343 | 1998/7/9  | 5.96%                            | 5.80%                            | 0.16%                            |
| 68 | 1997/10/7  | 6.38%                            | 5.98%                            | 0.40%                            | 160 | 1998/1/7   | 6.01%                            | 5.79%                            | 0.22%                            | 252 | 1998/4/9  | 6.10%                            | 5.87%                            | 0.23%                            | 344 | 1998/7/10 | 5.97%                            | 5.79%                            | 0.18%                            |
| 69 | 1997/10/8  | 6.55%                            | 6.10%                            | 0.45%                            | 161 | 1998/1/8   | 5.98%                            | 5.68%                            | 0.30%                            | 253 | 1998/4/10 | 6.10%                            | 5.87%                            | 0.23%                            | 345 | 1998/7/11 | 5.97%                            | 5.79%                            | 0.18%                            |
| 70 | 1997/10/9  | 6.54%                            | 6.10%                            | 0.44%                            | 162 | 1998/1/9   | 5.94%                            | 5.57%                            | 0.37%                            | 254 | 1998/4/11 | 6.10%                            | 5.87%                            | 0.23%                            | 346 | 1998/7/12 | 5.97%                            | 5.79%                            | 0.18%                            |
| 71 | 1997/10/10 | 6.60%                            | 6.18%                            | 0.42%                            | 163 | 1998/1/10  | 5.94%                            | 5.57%                            | 0.37%                            | 255 | 1998/4/12 | 6.10%                            | 5.87%                            | 0.23%                            | 347 | 1998/7/13 | 6.04%                            | 5.84%                            | 0.20%                            |
| 72 | 1997/10/11 | 6.60%                            | 6.18%                            | 0.42%                            | 164 | 1998/1/11  | 5.94%                            | 5.57%                            | 0.37%                            | 256 | 1998/4/13 | 6.17%                            | 5.94%                            | 0.23%                            | 348 | 1998/7/14 | 6.05%                            | 5.84%                            | 0.21%                            |
| 73 | 1997/10/12 | 6.60%                            | 6.18%                            | 0.42%                            | 165 | 1998/1/12  | 5.90%                            | 5.56%                            | 0.34%                            | 257 | 1998/4/14 | 6.12%                            | 5.93%                            | 0.19%                            | 349 | 1998/7/15 | 6.05%                            | 5.83%                            | 0.22%                            |
| 74 | 1997/10/13 | 6.61%                            | 6.18%                            | 0.43%                            | 166 | 1998/1/13  | 5.95%                            | 5.65%                            | 0.30%                            | 258 | 1998/4/15 | 6.10%                            | 5.92%                            | 0.18%                            | 350 | 1998/7/16 | 6.06%                            | 5.84%                            | 0.22%                            |
| 75 | 1997/10/14 | 6.54%                            | 6.14%                            | 0.40%                            | 167 | 1998/1/14  | 5.96%                            | 5.65%                            | 0.31%                            | 259 | 1998/4/16 | 6.09%                            | 5.89%                            | 0.20%                            | 351 | 1998/7/17 | 6.07%                            | 5.84%                            | 0.23%                            |
| 76 | 1997/10/15 | 6.58%                            | 6.16%                            | 0.42%                            | 168 | 1998/1/15  | 5.97%                            | 5.63%                            | 0.34%                            | 260 | 1998/4/17 | 6.10%                            | 5.90%                            | 0.20%                            | 352 | 1998/7/18 | 6.07%                            | 5.84%                            | 0.23%                            |
| 77 | 1997/10/16 | 6.57%                            | 6.18%                            | 0.39%                            | 169 | 1998/1/16  | 6.03%                            | 5.72%                            | 0.31%                            | 261 | 1998/4/18 | 6.10%                            | 5.90%                            | 0.20%                            | 353 | 1998/7/19 | 6.07%                            | 5.84%                            | 0.23%                            |
| 78 | 1997/10/17 | 6.64%                            | 6.26%                            | 0.38%                            | 170 | 1998/1/17  | 6.03%                            | 5.72%                            | 0.31%                            | 262 | 1998/4/19 | 6.10%                            | 5.90%                            | 0.20%                            | 354 | 1998/7/20 | 6.03%                            | 5.84%                            | 0.19%                            |
| 79 | 1997/10/18 | 6.64%                            | 6.26%                            | 0.38%                            | 171 | 1998/1/18  | 6.03%                            | 5.72%                            | 0.31%                            | 263 | 1998/4/20 | 6.16%                            | 5.95%                            | 0.21%                            | 355 | 1998/7/21 | 6.00%                            | 5.83%                            | 0.17%                            |
| 80 | 1997/10/19 | 6.64%                            | 6.26%                            | 0.38%                            | 172 | 1998/1/19  | 6.03%                            | 5.71%                            | 0.32%                            | 264 | 1998/4/21 | 6.17%                            | 5.97%                            | 0.20%                            | 356 | 1998/7/22 | 6.02%                            | 5.84%                            | 0.18%                            |
| 81 | 1997/10/20 | 6.62%                            | 6.24%                            | 0.38%                            | 173 | 1998/1/20  | 6.07%                            | 5.73%                            | 0.34%                            | 265 | 1998/4/22 | 6.17%                            | 5.97%                            | 0.20%                            | 357 | 1998/7/23 | 6.00%                            | 5.84%                            | 0.16%                            |
| 82 | 1997/10/21 | 6.61%                            | 6.24%                            | 0.37%                            | 174 | 1998/1/21  | 6.03%                            | 5.69%                            | 0.34%                            | 266 | 1998/4/23 | 6.19%                            | 5.99%                            | 0.20%                            | 358 | 1998/7/24 | 6.02%                            | 5.86%                            | 0.16%                            |
| 83 | 1997/10/22 | 6.60%                            | 6.25%                            | 0.35%                            | 175 | 1998/1/22  | 6.06%                            | 5.68%                            | 0.38%                            | 267 | 1998/4/24 | 6.15%                            | 5.98%                            | 0.17%                            | 359 | 1998/7/25 | 6.02%                            | 5.86%                            | 0.16%                            |
| 84 | 1997/10/23 | 6.49%                            | 6.15%                            | 0.34%                            | 176 | 1998/1/23  | 6.18%                            | 5.75%                            | 0.43%                            | 268 | 1998/4/25 | 6.15%                            | 5.98%                            | 0.17%                            | 360 | 1998/7/26 | 6.02%                            | 5.86%                            | 0.16%                            |
| 85 | 1997/10/24 | 6.47%                            | 6.10%                            | 0.37%                            | 177 | 1998/1/24  | 6.18%                            | 5.75%                            | 0.43%                            | 269 | 1998/4/26 | 6.15%                            | 5.98%                            | 0.17%                            | 361 | 1998/7/27 | 6.03%                            | 5.85%                            | 0.18%                            |
| 86 | 1997/10/25 | 6.47%                            | 6.10%                            | 0.37%                            | 178 | 1998/1/25  | 6.18%                            | 5.75%                            | 0.43%                            | 270 | 1998/4/27 | 6.26%                            | 6.06%                            | 0.20%                            | 362 | 1998/7/28 | 6.05%                            | 5.85%                            | 0.20%                            |
| 87 | 1997/10/26 | 6.47%                            | 6.10%                            | 0.37%                            | 179 | 1998/1/26  | 6.11%                            | 5.72%                            | 0.39%                            | 271 | 1998/4/28 | 6.30%                            | 6.09%                            | 0.21%                            | 363 | 1998/7/29 | 6.08%                            | 5.90%                            | 0.18%                            |
| 88 | 1997/10/27 | 6.50%                            | 6.16%                            | 0.34%                            | 180 | 1998/1/27  | 6.16%                            | 5.79%                            | 0.37%                            | 272 | 1998/4/29 | 6.30%                            | 6.10%                            | 0.20%                            | 364 | 1998/7/30 | 6.06%                            | 5.89%                            | 0.17%                            |
| 89 | 1997/10/28 | 6.50%                            | 6.10%                            | 0.40%                            | 181 | 1998/1/28  | 6.16%                            | 5.79%                            | 0.37%                            | 273 | 1998/4/30 | 6.17%                            | 5.97%                            | 0.20%                            | 365 | 1998/7/31 | 6.05%                            | 5.88%                            | 0.17%                            |
| 90 | 1997/10/29 | 6.40%                            | 6.00%                            | 0.40%                            | 182 | 1998/1/29  | 6.04%                            | 5.70%                            | 0.34%                            | 274 | 1998/5/1  | 6.16%                            | 5.97%                            | 0.19%                            |     |           |                                  |                                  |                                  |
| 91 | 1997/10/30 | 6.35%                            | 6.00%                            | 0.35%                            | 183 | 1998/1/30  | 5.99%                            | 5.66%                            | 0.33%                            | 275 | 1998/5/2  | 6.16%                            | 5.97%                            | 0.19%                            |     |           |                                  |                                  |                                  |
| 92 | 1997/10/31 | 6.37%                            | 6.02%                            | 0.35%                            | 184 | 1998/1/31  | 5.99%                            | 5.66%                            | 0.33%                            | 276 | 1998/5/3  | 6.16%                            | 5.97%                            | 0.19%                            |     |           |                                  |                                  |                                  |

註：1.該日非 CMS 報價日時，其利率以前一報價日之利率計算。

2.觀察日後之利率（1998/7/28 至 1998/7/31）以觀察日之利率估算。

則  $G_1 =$  第 1 觀察期期間內，所有結構型債券評價日之日數（即上表所列日數）=365(日)

$g_1 =$  第 1 觀察期期間內， $Spread_t^d$  落在規定區間 0%~0.50%內之日數合計（即上表所列陰影區域之日數）=345(日)

第 1 期之收益分配率為

$$R_1 = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 7\% + 100\% \times \text{Portfolio}_1 \right) \times \frac{\delta_1}{G_1}, 1\% \right], 10\% \right\} = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 7\% + 100\% \times 0.18\% \right) \times \frac{345}{365}, 1\% \right], 10\% \right\}$$

$$= \text{Min} \{ \text{Max} ( 6.79\%, 1\% ), 10\% \} = 6.79\%$$

收益分配=10,000 美元 × 6.79% = 679 美元

● 第 2 期期間 (1998/8/1~1999/7/31),  $h = 2$

假設第 2 觀察期 (1998/8/1~1999/7/31) 之 [10]CMS<sub>2</sub><sup>d</sup>、[2]CMS<sub>2</sub><sup>d</sup> 及兩者差異 Spread<sub>2</sub><sup>d</sup> 每日變化如下表：

| d  | 評價日       | [10]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>2</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日        | [10]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>2</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [10]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>2</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [10]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>2</sub> <sup>d</sup> |
|----|-----------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|------------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 1  | 1998/8/1  | 6.05%                             | 5.88%                            | 0.17%                            | 93  | 1998/11/1  | 5.37%                             | 4.70%                            | 0.67%                            | 185 | 1999/2/1  | 5.46%                             | 5.15%                            | 0.31%                            | 277 | 1999/5/4  | 6.10%                             | 5.54%                            | 0.56%                            |
| 2  | 1998/8/2  | 6.05%                             | 5.88%                            | 0.17%                            | 94  | 1998/11/2  | 5.57%                             | 4.84%                            | 0.73%                            | 186 | 1999/2/2  | 5.53%                             | 5.21%                            | 0.32%                            | 278 | 1999/5/5  | 6.08%                             | 5.54%                            | 0.54%                            |
| 3  | 1998/8/3  | 6.01%                             | 5.85%                            | 0.16%                            | 95  | 1998/11/3  | 5.52%                             | 4.80%                            | 0.72%                            | 187 | 1999/2/3  | 5.59%                             | 5.22%                            | 0.37%                            | 279 | 1999/5/6  | 6.17%                             | 5.60%                            | 0.57%                            |
| 4  | 1998/8/4  | 5.98%                             | 5.80%                            | 0.18%                            | 96  | 1998/11/4  | 5.63%                             | 4.96%                            | 0.67%                            | 188 | 1999/2/4  | 5.62%                             | 5.26%                            | 0.36%                            | 280 | 1999/5/7  | 6.20%                             | 5.59%                            | 0.61%                            |
| 5  | 1998/8/5  | 6.01%                             | 5.83%                            | 0.18%                            | 97  | 1998/11/5  | 5.64%                             | 5.03%                            | 0.61%                            | 189 | 1999/2/5  | 5.68%                             | 5.31%                            | 0.37%                            | 281 | 1999/5/8  | 6.20%                             | 5.59%                            | 0.61%                            |
| 6  | 1998/8/6  | 6.03%                             | 5.82%                            | 0.21%                            | 98  | 1998/11/6  | 5.68%                             | 5.12%                            | 0.56%                            | 190 | 1999/2/6  | 5.68%                             | 5.31%                            | 0.37%                            | 282 | 1999/5/9  | 6.20%                             | 5.59%                            | 0.61%                            |
| 7  | 1998/8/7  | 6.00%                             | 5.78%                            | 0.22%                            | 99  | 1998/11/7  | 5.68%                             | 5.12%                            | 0.56%                            | 191 | 1999/2/7  | 5.68%                             | 5.31%                            | 0.37%                            | 283 | 1999/5/10 | 6.18%                             | 5.55%                            | 0.63%                            |
| 8  | 1998/8/8  | 6.00%                             | 5.78%                            | 0.22%                            | 100 | 1998/11/8  | 5.68%                             | 5.12%                            | 0.56%                            | 192 | 1999/2/8  | 5.68%                             | 5.30%                            | 0.38%                            | 284 | 1999/5/11 | 6.21%                             | 5.58%                            | 0.63%                            |
| 9  | 1998/8/9  | 6.00%                             | 5.78%                            | 0.22%                            | 101 | 1998/11/9  | 5.58%                             | 5.09%                            | 0.49%                            | 193 | 1999/2/9  | 5.65%                             | 5.26%                            | 0.39%                            | 285 | 1999/5/12 | 6.21%                             | 5.57%                            | 0.64%                            |
| 10 | 1998/8/10 | 6.00%                             | 5.78%                            | 0.22%                            | 102 | 1998/11/10 | 5.54%                             | 5.03%                            | 0.51%                            | 194 | 1999/2/10 | 5.69%                             | 5.25%                            | 0.44%                            | 286 | 1999/5/13 | 6.12%                             | 5.51%                            | 0.61%                            |
| 11 | 1998/8/11 | 6.01%                             | 5.76%                            | 0.25%                            | 103 | 1998/11/11 | 5.54%                             | 5.03%                            | 0.51%                            | 195 | 1999/2/11 | 5.70%                             | 5.32%                            | 0.38%                            | 287 | 1999/5/14 | 6.34%                             | 5.68%                            | 0.66%                            |
| 12 | 1998/8/12 | 6.00%                             | 5.75%                            | 0.25%                            | 104 | 1998/11/12 | 5.51%                             | 5.02%                            | 0.49%                            | 196 | 1999/2/12 | 5.81%                             | 5.34%                            | 0.47%                            | 288 | 1999/5/15 | 6.34%                             | 5.68%                            | 0.66%                            |
| 13 | 1998/8/13 | 6.05%                             | 5.80%                            | 0.25%                            | 105 | 1998/11/13 | 5.55%                             | 5.05%                            | 0.50%                            | 197 | 1999/2/13 | 5.81%                             | 5.34%                            | 0.47%                            | 289 | 1999/5/16 | 6.34%                             | 5.68%                            | 0.66%                            |
| 14 | 1998/8/14 | 6.01%                             | 5.74%                            | 0.27%                            | 106 | 1998/11/14 | 5.55%                             | 5.05%                            | 0.50%                            | 198 | 1999/2/14 | 5.81%                             | 5.34%                            | 0.47%                            | 290 | 1999/5/17 | 6.35%                             | 5.69%                            | 0.66%                            |
| 15 | 1998/8/15 | 6.01%                             | 5.74%                            | 0.27%                            | 107 | 1998/11/15 | 5.55%                             | 5.05%                            | 0.50%                            | 199 | 1999/2/15 | 5.83%                             | 5.39%                            | 0.44%                            | 291 | 1999/5/18 | 6.37%                             | 5.75%                            | 0.62%                            |
| 16 | 1998/8/16 | 6.01%                             | 5.74%                            | 0.27%                            | 108 | 1998/11/16 | 5.63%                             | 5.10%                            | 0.53%                            | 200 | 1999/2/16 | 5.78%                             | 5.37%                            | 0.41%                            | 292 | 1999/5/19 | 6.33%                             | 5.76%                            | 0.57%                            |
| 17 | 1998/8/17 | 6.03%                             | 5.75%                            | 0.28%                            | 109 | 1998/11/17 | 5.61%                             | 5.07%                            | 0.54%                            | 201 | 1999/2/17 | 5.74%                             | 5.36%                            | 0.38%                            | 293 | 1999/5/20 | 6.36%                             | 5.76%                            | 0.60%                            |
| 18 | 1998/8/18 | 6.05%                             | 5.76%                            | 0.29%                            | 110 | 1998/11/18 | 5.59%                             | 5.04%                            | 0.55%                            | 202 | 1999/2/18 | 5.80%                             | 5.37%                            | 0.43%                            | 294 | 1999/5/21 | 6.31%                             | 5.72%                            | 0.59%                            |
| 19 | 1998/8/19 | 6.05%                             | 5.77%                            | 0.28%                            | 111 | 1998/11/19 | 5.58%                             | 5.11%                            | 0.47%                            | 203 | 1999/2/19 | 5.82%                             | 5.41%                            | 0.41%                            | 295 | 1999/5/22 | 6.31%                             | 5.72%                            | 0.59%                            |
| 20 | 1998/8/20 | 6.05%                             | 5.76%                            | 0.29%                            | 112 | 1998/11/20 | 5.55%                             | 5.12%                            | 0.43%                            | 204 | 1999/2/20 | 5.82%                             | 5.41%                            | 0.41%                            | 296 | 1999/5/23 | 6.31%                             | 5.72%                            | 0.59%                            |
| 21 | 1998/8/21 | 6.04%                             | 5.68%                            | 0.36%                            | 113 | 1998/11/21 | 5.55%                             | 5.12%                            | 0.43%                            | 205 | 1999/2/21 | 5.82%                             | 5.41%                            | 0.41%                            | 297 | 1999/5/24 | 6.29%                             | 5.73%                            | 0.56%                            |
| 22 | 1998/8/22 | 6.04%                             | 5.68%                            | 0.36%                            | 114 | 1998/11/22 | 5.55%                             | 5.12%                            | 0.43%                            | 206 | 1999/2/22 | 5.77%                             | 5.42%                            | 0.35%                            | 298 | 1999/5/25 | 6.28%                             | 5.72%                            | 0.56%                            |
| 23 | 1998/8/23 | 6.04%                             | 5.68%                            | 0.36%                            | 115 | 1998/11/23 | 5.61%                             | 5.19%                            | 0.42%                            | 207 | 1999/2/23 | 5.84%                             | 5.47%                            | 0.37%                            | 299 | 1999/5/26 | 6.35%                             | 5.80%                            | 0.55%                            |
| 24 | 1998/8/24 | 6.09%                             | 5.69%                            | 0.40%                            | 116 | 1998/11/24 | 5.58%                             | 5.20%                            | 0.38%                            | 208 | 1999/2/24 | 5.91%                             | 5.55%                            | 0.36%                            | 300 | 1999/5/27 | 6.40%                             | 5.86%                            | 0.54%                            |
| 25 | 1998/8/25 | 6.06%                             | 5.66%                            | 0.40%                            | 117 | 1998/11/25 | 5.60%                             | 5.21%                            | 0.39%                            | 209 | 1999/2/25 | 6.07%                             | 5.66%                            | 0.41%                            | 301 | 1999/5/28 | 6.41%                             | 5.86%                            | 0.55%                            |
| 26 | 1998/8/26 | 6.00%                             | 5.62%                            | 0.38%                            | 118 | 1998/11/26 | 5.59%                             | 5.20%                            | 0.39%                            | 210 | 1999/2/26 | 6.03%                             | 5.64%                            | 0.39%                            | 302 | 1999/5/29 | 6.41%                             | 5.86%                            | 0.55%                            |
| 27 | 1998/8/27 | 5.91%                             | 5.52%                            | 0.39%                            | 119 | 1998/11/27 | 5.58%                             | 5.17%                            | 0.41%                            | 211 | 1999/2/27 | 6.03%                             | 5.64%                            | 0.39%                            | 303 | 1999/5/30 | 6.41%                             | 5.86%                            | 0.55%                            |
| 28 | 1998/8/28 | 5.89%                             | 5.48%                            | 0.41%                            | 120 | 1998/11/28 | 5.58%                             | 5.17%                            | 0.41%                            | 212 | 1999/2/28 | 6.03%                             | 5.64%                            | 0.39%                            | 304 | 1999/5/31 | 6.42%                             | 5.86%                            | 0.56%                            |
| 29 | 1998/8/29 | 5.89%                             | 5.48%                            | 0.41%                            | 121 | 1998/11/29 | 5.58%                             | 5.17%                            | 0.41%                            | 213 | 1999/3/1  | 6.13%                             | 5.68%                            | 0.45%                            | 305 | 1999/6/1  | 6.55%                             | 5.99%                            | 0.56%                            |
| 30 | 1998/8/30 | 5.89%                             | 5.48%                            | 0.41%                            | 122 | 1998/11/30 | 5.53%                             | 5.07%                            | 0.46%                            | 214 | 1999/3/2  | 6.09%                             | 5.68%                            | 0.41%                            | 306 | 1999/6/2  | 6.56%                             | 5.99%                            | 0.57%                            |
| 31 | 1998/8/31 | 5.81%                             | 5.36%                            | 0.45%                            | 123 | 1998/12/1  | 5.49%                             | 5.05%                            | 0.44%                            | 215 | 1999/3/3  | 6.14%                             | 5.66%                            | 0.48%                            | 307 | 1999/6/3  | 6.60%                             | 5.99%                            | 0.61%                            |
| 32 | 1998/9/1  | 5.89%                             | 5.46%                            | 0.43%                            | 124 | 1998/12/2  | 5.46%                             | 5.00%                            | 0.46%                            | 216 | 1999/3/4  | 6.18%                             | 5.69%                            | 0.49%                            | 308 | 1999/6/4  | 6.59%                             | 6.00%                            | 0.59%                            |
| 33 | 1998/9/2  | 5.85%                             | 5.47%                            | 0.38%                            | 125 | 1998/12/3  | 5.40%                             | 4.91%                            | 0.49%                            | 217 | 1999/3/5  | 6.07%                             | 5.59%                            | 0.48%                            | 309 | 1999/6/5  | 6.59%                             | 6.00%                            | 0.59%                            |
| 34 | 1998/9/3  | 5.80%                             | 5.45%                            | 0.35%                            | 126 | 1998/12/4  | 5.48%                             | 5.04%                            | 0.44%                            | 218 | 1999/3/6  | 6.07%                             | 5.59%                            | 0.48%                            | 310 | 1999/6/6  | 6.59%                             | 6.00%                            | 0.59%                            |
| 35 | 1998/9/4  | 5.78%                             | 5.43%                            | 0.35%                            | 127 | 1998/12/5  | 5.48%                             | 5.04%                            | 0.44%                            | 219 | 1999/3/7  | 6.07%                             | 5.59%                            | 0.48%                            | 311 | 1999/6/7  | 6.59%                             | 6.01%                            | 0.58%                            |
| 36 | 1998/9/5  | 5.78%                             | 5.43%                            | 0.35%                            | 128 | 1998/12/6  | 5.48%                             | 5.04%                            | 0.44%                            | 220 | 1999/3/8  | 6.05%                             | 5.60%                            | 0.45%                            | 312 | 1999/6/8  | 6.61%                             | 6.01%                            | 0.60%                            |
| 37 | 1998/9/6  | 5.78%                             | 5.43%                            | 0.35%                            | 129 | 1998/12/7  | 5.50%                             | 5.10%                            | 0.40%                            | 221 | 1999/3/9  | 5.97%                             | 5.49%                            | 0.48%                            | 313 | 1999/6/9  | 6.67%                             | 6.06%                            | 0.61%                            |
| 38 | 1998/9/7  | 5.78%                             | 5.43%                            | 0.35%                            | 130 | 1998/12/8  | 5.43%                             | 5.03%                            | 0.40%                            | 222 | 1999/3/10 | 6.00%                             | 5.54%                            | 0.46%                            | 314 | 1999/6/10 | 6.71%                             | 6.09%                            | 0.62%                            |
| 39 | 1998/9/8  | 5.78%                             | 5.41%                            | 0.37%                            | 131 | 1998/12/9  | 5.42%                             | 5.02%                            | 0.40%                            | 223 | 1999/3/11 | 6.00%                             | 5.53%                            | 0.47%                            | 315 | 1999/6/11 | 6.84%                             | 6.15%                            | 0.69%                            |
| 40 | 1998/9/9  | 5.66%                             | 5.26%                            | 0.40%                            | 132 | 1998/12/10 | 5.33%                             | 4.97%                            | 0.36%                            | 224 | 1999/3/12 | 5.96%                             | 5.49%                            | 0.47%                            | 316 | 1999/6/12 | 6.84%                             | 6.15%                            | 0.69%                            |
| 41 | 1998/9/10 | 5.57%                             | 5.15%                            | 0.42%                            | 133 | 1998/12/11 | 5.46%                             | 5.03%                            | 0.43%                            | 225 | 1999/3/13 | 5.96%                             | 5.49%                            | 0.47%                            | 317 | 1999/6/13 | 6.84%                             | 6.15%                            | 0.69%                            |
| 42 | 1998/9/11 | 5.65%                             | 5.19%                            | 0.46%                            | 134 | 1998/12/12 | 5.46%                             | 5.03%                            | 0.43%                            | 226 | 1999/3/14 | 5.96%                             | 5.49%                            | 0.47%                            | 318 | 1999/6/14 | 6.81%                             | 6.11%                            | 0.70%                            |
| 43 | 1998/9/12 | 5.65%                             | 5.19%                            | 0.46%                            | 135 | 1998/12/13 | 5.46%                             | 5.03%                            | 0.43%                            | 227 | 1999/3/15 | 5.95%                             | 5.47%                            | 0.48%                            | 319 | 1999/6/15 | 6.81%                             | 6.12%                            | 0.69%                            |
| 44 | 1998/9/13 | 5.65%                             | 5.19%                            | 0.46%                            | 136 | 1998/12/14 | 5.42%                             | 4.98%                            | 0.44%                            | 228 | 1999/3/16 | 5.89%                             | 5.44%                            | 0.45%                            | 320 | 1999/6/16 | 6.76%                             | 6.04%                            | 0.72%                            |
| 45 | 1998/9/14 | 5.66%                             | 5.22%                            | 0.44%                            | 137 | 1998/12/15 | 5.46%                             | 5.02%                            | 0.44%                            | 229 | 1999/3/17 | 5.91%                             | 5.45%                            | 0.46%                            | 321 | 1999/6/17 | 6.61%                             | 5.93%                            | 0.68%                            |
| 46 | 1998/9/15 | 5.68%                             | 5.24%                            | 0.44%                            | 138 | 1998/12/16 | 5.40%                             | 4.92%                            | 0.48%                            | 230 | 1999/3/18 | 5.90%                             | 5.44%                            | 0.46%                            | 322 | 1999/6/18 | 6.63%                             | 5.98%                            | 0.65%                            |
| 47 | 1998/9/16 | 5.66%                             | 5.24%                            | 0.42%                            | 139 | 1998/12/17 | 5.43%                             | 5.01%                            | 0.42%                            | 231 | 1999/3/19 | 5.96%                             | 5.49%                            | 0.47%                            | 323 | 1999/6/19 | 6.63%                             | 5.98%                            | 0.65%                            |
| 48 | 1998/9/17 | 5.61%                             | 5.18%                            | 0.43%                            | 140 | 1998/12/18 | 5.42%                             | 5.01%                            | 0.41%                            | 232 | 1999/3/20 | 5.96%                             | 5.49%                            | 0.47%                            | 324 | 1999/6/20 | 6.63%                             | 5.98%                            | 0.65%                            |
| 49 | 1998/9/18 | 5.54%                             | 5.17%                            | 0.37%                            | 141 | 1998/12/19 | 5.42%                             | 5.01%                            | 0.41%                            | 233 | 1999/3/21 | 5.96%                             | 5.49%                            | 0.47%                            | 325 | 1999/6/21 | 6.68%                             | 6.02%                            | 0.66%                            |
| 50 | 1998/9/19 | 5.54%                             | 5.17%                            | 0.37%                            | 142 | 1998/12/20 | 5.42%                             | 5.01%                            | 0.41%                            | 234 | 1999/3/22 | 5.98%                             | 5.51%                            | 0.47%                            | 326 | 1999/6/22 | 6.73%                             | 6.05%                            | 0.68%                            |
| 51 | 1998/9/20 | 5.54%                             | 5.17%                            | 0.37%                            | 143 | 1998/12/21 | 5.49%                             | 5.08%                            | 0.41%                            | 235 | 1999/3/23 | 5.94%                             | 5.45%                            | 0.49%                            | 327 | 1999/6/23 | 6.85%                             | 6.14%                            | 0.71%                            |
| 52 | 1998/9/21 | 5.54%                             | 5.16%                            | 0.38%                            | 144 | 1998/12/22 | 5.54%                             | 5.11%                            | 0.43%                            | 236 | 1999/3/24 | 5.96%                             | 5.46%                            | 0.50%                            | 328 | 1999/6/24 | 6.87%                             | 6.14%                            | 0.73%                            |
| 53 | 1998/9/22 | 5.56%                             | 5.16%                            | 0.40%                            | 145 | 1998/12/23 | 5.62%                             | 5.24%                            | 0.38%                            | 237 | 1999/3/25 | 6.00%                             | 5.49%                            | 0.51%                            | 329 | 1999/6/25 | 6.86%                             | 6.16%                            | 0.70%                            |
| 54 | 1998/9/23 | 5.51%                             | 5.05%                            | 0.46%                            | 146 | 1998/12/24 | 5.63%                             | 5.26%                            | 0.37%                            | 238 | 1999/3/26 | 6.00%                             | 5.47%                            | 0.53%                            | 330 | 1999/6/26 | 6.86%                             | 6.16%                            | 0.70%                            |
| 55 | 1998/9/24 | 5.43%                             | 4.95%                            | 0.48%                            | 147 | 1998/12/25 | 5.64%                             | 5.27%                            | 0.37%                            | 239 | 1999/3/27 | 6.00%                             | 5.47%                            | 0.53%                            | 331 | 1999/6/27 | 6.86%                             | 6.16%                            | 0.70%                            |
| 56 | 1998/9/25 | 5.39%                             | 4.93%                            | 0.46%                            | 148 | 1998/12/26 | 5.64%                             | 5.27%                            | 0.37%                            | 240 | 1999/3/28 | 6.00%                             | 5.47%                            | 0.53%                            | 332 | 1999/6/28 | 6.79%                             | 6.10%                            | 0.69%                            |
| 57 | 1998/9/26 | 5.39%                             | 4.93%                            | 0.46%                            | 149 | 1998/12/27 | 5.64%                             | 5.27%                            | 0.37%                            | 241 | 1999/3/29 | 6.05%                             | 5.47%                            | 0.58%                            | 333 | 1999/6/29 | 6.78%                             | 6.14%                            | 0.64%                            |

| d  | 評價日        | [10]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>2</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日        | [10]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>2</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [10]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>2</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [10]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>2</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>2</sub> <sup>d</sup> |
|----|------------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|------------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 58 | 1998/9/27  | 5.39%                             | 4.93%                            | 0.46%                            | 150 | 1998/12/28 | 5.56%                             | 5.21%                            | 0.35%                            | 242 | 1999/3/30 | 5.98%                             | 5.42%                            | 0.56%                            | 334 | 1999/6/30 | 6.62%                             | 5.99%                            | 0.63%                            |
| 59 | 1998/9/28  | 5.40%                             | 4.95%                            | 0.45%                            | 151 | 1998/12/29 | 5.50%                             | 5.16%                            | 0.34%                            | 243 | 1999/3/31 | 6.01%                             | 5.43%                            | 0.58%                            | 335 | 1999/7/1  | 6.69%                             | 6.04%                            | 0.65%                            |
| 60 | 1998/9/29  | 5.37%                             | 4.95%                            | 0.42%                            | 152 | 1998/12/30 | 5.46%                             | 5.12%                            | 0.34%                            | 244 | 1999/4/1  | 6.04%                             | 5.46%                            | 0.58%                            | 336 | 1999/7/2  | 6.67%                             | 6.05%                            | 0.62%                            |
| 61 | 1998/9/30  | 5.22%                             | 4.79%                            | 0.43%                            | 153 | 1998/12/31 | 5.45%                             | 5.11%                            | 0.34%                            | 245 | 1999/4/2  | 5.99%                             | 5.43%                            | 0.56%                            | 337 | 1999/7/3  | 6.67%                             | 6.05%                            | 0.62%                            |
| 62 | 1998/10/1  | 5.17%                             | 4.73%                            | 0.44%                            | 154 | 1999/1/1   | 5.45%                             | 5.13%                            | 0.32%                            | 246 | 1999/4/3  | 5.99%                             | 5.43%                            | 0.56%                            | 338 | 1999/7/4  | 6.67%                             | 6.05%                            | 0.62%                            |
| 63 | 1998/10/2  | 5.17%                             | 4.75%                            | 0.42%                            | 155 | 1999/1/2   | 5.45%                             | 5.13%                            | 0.32%                            | 247 | 1999/4/4  | 5.99%                             | 5.43%                            | 0.56%                            | 339 | 1999/7/5  | 6.66%                             | 6.04%                            | 0.62%                            |
| 64 | 1998/10/3  | 5.17%                             | 4.75%                            | 0.42%                            | 156 | 1999/1/3   | 5.45%                             | 5.13%                            | 0.32%                            | 248 | 1999/4/5  | 5.98%                             | 5.42%                            | 0.56%                            | 340 | 1999/7/6  | 6.70%                             | 6.07%                            | 0.63%                            |
| 65 | 1998/10/4  | 5.17%                             | 4.75%                            | 0.42%                            | 157 | 1999/1/4   | 5.43%                             | 5.10%                            | 0.33%                            | 249 | 1999/4/6  | 5.90%                             | 5.37%                            | 0.53%                            | 341 | 1999/7/7  | 6.74%                             | 6.08%                            | 0.66%                            |
| 66 | 1998/10/5  | 5.10%                             | 4.64%                            | 0.46%                            | 158 | 1999/1/5   | 5.45%                             | 5.16%                            | 0.29%                            | 250 | 1999/4/7  | 5.89%                             | 5.38%                            | 0.51%                            | 342 | 1999/7/8  | 6.67%                             | 6.04%                            | 0.63%                            |
| 67 | 1998/10/6  | 5.13%                             | 4.68%                            | 0.45%                            | 159 | 1999/1/6   | 5.47%                             | 5.10%                            | 0.37%                            | 251 | 1999/4/8  | 5.82%                             | 5.35%                            | 0.47%                            | 343 | 1999/7/9  | 6.67%                             | 6.07%                            | 0.60%                            |
| 68 | 1998/10/7  | 5.29%                             | 4.77%                            | 0.52%                            | 160 | 1999/1/7   | 5.53%                             | 5.16%                            | 0.37%                            | 252 | 1999/4/9  | 5.83%                             | 5.35%                            | 0.48%                            | 344 | 1999/7/10 | 6.67%                             | 6.07%                            | 0.60%                            |
| 69 | 1998/10/8  | 5.48%                             | 4.82%                            | 0.66%                            | 161 | 1999/1/8   | 5.64%                             | 5.25%                            | 0.39%                            | 253 | 1999/4/10 | 5.83%                             | 5.35%                            | 0.48%                            | 345 | 1999/7/11 | 6.67%                             | 6.07%                            | 0.60%                            |
| 70 | 1998/10/9  | 5.70%                             | 4.92%                            | 0.78%                            | 162 | 1999/1/9   | 5.64%                             | 5.25%                            | 0.39%                            | 254 | 1999/4/11 | 5.83%                             | 5.35%                            | 0.48%                            | 346 | 1999/7/12 | 6.60%                             | 6.01%                            | 0.59%                            |
| 71 | 1998/10/10 | 5.70%                             | 4.92%                            | 0.78%                            | 163 | 1999/1/10  | 5.64%                             | 5.25%                            | 0.39%                            | 255 | 1999/4/12 | 5.82%                             | 5.37%                            | 0.45%                            | 347 | 1999/7/13 | 6.59%                             | 6.01%                            | 0.58%                            |
| 72 | 1998/10/11 | 5.70%                             | 4.92%                            | 0.78%                            | 164 | 1999/1/11  | 5.70%                             | 5.31%                            | 0.39%                            | 256 | 1999/4/13 | 5.87%                             | 5.38%                            | 0.49%                            | 348 | 1999/7/14 | 6.62%                             | 6.05%                            | 0.57%                            |
| 73 | 1998/10/12 | 5.70%                             | 4.91%                            | 0.79%                            | 165 | 1999/1/12  | 5.62%                             | 5.21%                            | 0.41%                            | 257 | 1999/4/14 | 5.89%                             | 5.40%                            | 0.49%                            | 349 | 1999/7/15 | 6.63%                             | 6.07%                            | 0.56%                            |
| 74 | 1998/10/13 | 5.66%                             | 4.82%                            | 0.84%                            | 166 | 1999/1/13  | 5.54%                             | 5.13%                            | 0.41%                            | 258 | 1999/4/15 | 5.93%                             | 5.42%                            | 0.51%                            | 350 | 1999/7/16 | 6.56%                             | 6.00%                            | 0.56%                            |
| 75 | 1998/10/14 | 5.55%                             | 4.82%                            | 0.73%                            | 167 | 1999/1/14  | 5.45%                             | 5.05%                            | 0.40%                            | 259 | 1999/4/16 | 5.97%                             | 5.47%                            | 0.50%                            | 351 | 1999/7/17 | 6.56%                             | 6.00%                            | 0.56%                            |
| 76 | 1998/10/15 | 5.43%                             | 4.71%                            | 0.72%                            | 168 | 1999/1/15  | 5.52%                             | 5.10%                            | 0.42%                            | 260 | 1999/4/17 | 5.97%                             | 5.47%                            | 0.50%                            | 352 | 1999/7/18 | 6.56%                             | 6.00                             | 0.56%                            |
| 77 | 1998/10/16 | 5.34%                             | 4.56%                            | 0.78%                            | 169 | 1999/1/16  | 5.52%                             | 5.10%                            | 0.42%                            | 261 | 1999/4/18 | 5.97%                             | 5.47%                            | 0.50%                            | 353 | 1999/7/19 | 6.56%                             | 5.99%                            | 0.57%                            |
| 78 | 1998/10/17 | 5.34%                             | 4.56%                            | 0.78%                            | 170 | 1999/1/17  | 5.52%                             | 5.10%                            | 0.42%                            | 262 | 1999/4/19 | 5.90%                             | 5.41%                            | 0.49%                            | 354 | 1999/7/20 | 6.53%                             | 5.94%                            | 0.59%                            |
| 79 | 1998/10/18 | 5.34%                             | 4.56%                            | 0.78%                            | 171 | 1999/1/18  | 5.50%                             | 5.10%                            | 0.40%                            | 263 | 1999/4/20 | 5.90%                             | 5.42%                            | 0.48%                            | 355 | 1999/7/21 | 6.55%                             | 5.93%                            | 0.62%                            |
| 80 | 1998/10/19 | 5.33%                             | 4.55%                            | 0.78%                            | 172 | 1999/1/19  | 5.50%                             | 5.05%                            | 0.45%                            | 264 | 1999/4/21 | 5.93%                             | 5.44%                            | 0.49%                            | 356 | 1999/7/22 | 6.67%                             | 6.04%                            | 0.63%                            |
| 81 | 1998/10/20 | 5.41%                             | 4.61%                            | 0.80%                            | 173 | 1999/1/20  | 5.52%                             | 5.16%                            | 0.36%                            | 265 | 1999/4/22 | 5.99%                             | 5.49%                            | 0.50%                            | 357 | 1999/7/23 | 6.73%                             | 6.12%                            | 0.61%                            |
| 82 | 1998/10/21 | 5.41%                             | 4.65%                            | 0.76%                            | 174 | 1999/1/21  | 5.46%                             | 5.10%                            | 0.36%                            | 266 | 1999/4/23 | 5.99%                             | 5.48%                            | 0.51%                            | 358 | 1999/7/24 | 6.73%                             | 6.12%                            | 0.61%                            |
| 83 | 1998/10/22 | 5.45%                             | 4.67%                            | 0.78%                            | 175 | 1999/1/22  | 5.42%                             | 5.06%                            | 0.36%                            | 267 | 1999/4/24 | 5.99%                             | 5.48%                            | 0.51%                            | 359 | 1999/7/25 | 6.73%                             | 6.12%                            | 0.61%                            |
| 84 | 1998/10/23 | 5.55%                             | 4.70%                            | 0.85%                            | 176 | 1999/1/23  | 5.42%                             | 5.06%                            | 0.36%                            | 268 | 1999/4/25 | 5.99%                             | 5.48%                            | 0.51%                            | 360 | 1999/7/26 | 6.84%                             | 6.16%                            | 0.68%                            |
| 85 | 1998/10/24 | 5.55%                             | 4.70%                            | 0.85%                            | 177 | 1999/1/24  | 5.42%                             | 5.06%                            | 0.36%                            | 269 | 1999/4/26 | 5.94%                             | 5.46%                            | 0.48%                            | 361 | 1999/7/27 | 6.80%                             | 6.13%                            | 0.67%                            |
| 86 | 1998/10/25 | 5.55%                             | 4.70%                            | 0.85%                            | 178 | 1999/1/25  | 5.42%                             | 5.09%                            | 0.33%                            | 270 | 1999/4/27 | 5.95%                             | 5.44%                            | 0.51%                            | 362 | 1999/7/28 | 6.77%                             | 6.12%                            | 0.65%                            |
| 87 | 1998/10/26 | 5.49%                             | 4.67%                            | 0.82%                            | 179 | 1999/1/26  | 5.48%                             | 5.11%                            | 0.37%                            | 271 | 1999/4/28 | 5.98%                             | 5.47%                            | 0.51%                            | 363 | 1999/7/29 | 6.86%                             | 6.22%                            | 0.64%                            |
| 88 | 1998/10/27 | 5.42%                             | 4.62%                            | 0.80%                            | 180 | 1999/1/27  | 5.48%                             | 5.09%                            | 0.39%                            | 272 | 1999/4/29 | 5.93%                             | 5.41%                            | 0.52%                            | 364 | 1999/7/30 | 6.90%                             | 6.27%                            | 0.63%                            |
| 89 | 1998/10/28 | 5.38%                             | 4.60%                            | 0.78%                            | 181 | 1999/1/28  | 5.44%                             | 5.11%                            | 0.33%                            | 273 | 1999/4/30 | 6.06%                             | 5.51%                            | 0.55%                            | 365 | 1999/7/31 | 6.90%                             | 6.27%                            | 0.63%                            |
| 90 | 1998/10/29 | 5.32%                             | 4.59%                            | 0.73%                            | 182 | 1999/1/29  | 5.40%                             | 5.13%                            | 0.27%                            | 274 | 1999/5/1  | 6.06%                             | 5.51%                            | 0.55%                            |     |           |                                   |                                  |                                  |
| 91 | 1998/10/30 | 5.37%                             | 4.70%                            | 0.67%                            | 183 | 1999/1/30  | 5.40%                             | 5.13%                            | 0.27%                            | 275 | 1999/5/2  | 6.06%                             | 5.51%                            | 0.55%                            |     |           |                                   |                                  |                                  |
| 92 | 1998/10/31 | 5.37%                             | 4.70%                            | 0.67%                            | 184 | 1999/1/31  | 5.40%                             | 5.13%                            | 0.27%                            | 276 | 1999/5/3  | 6.06%                             | 5.52%                            | 0.54%                            |     |           |                                   |                                  |                                  |

註：1.該日非 CMS 報價日時，其利率以前一報價日之利率計算。

2.觀察日後之利率（1999/7/27 至 1999/7/31）以觀察日之利率估算。

則  $G_2 =$  第 2 觀察期期間內，所有結構型債券評價日之日數（即上表所列日數）= 365(日)

$g_2 =$  第 2 觀察期期間內， $Spread_2^d$  落在規定區間 0%~0.75% 內之日數合計（即上表所列陰影區域之日數）= 347(日)

第 2 期之收益分配率為

$$R_2 = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 7\% + 100\% \times \text{Portfolio}_2 \right) \times \frac{g_2}{G_2}, 1\% \right], 10\% \right\} = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 7\% + 100\% \times 0.68\% \right) \times \frac{347}{365}, 1\% \right], 10\% \right\}$$

$$= \text{Min} \{ \text{Max} ( 7.30\%, 1\% ), 10\% \} = 7.30\%$$

$$\text{收益分配} = 10,000 \text{ 美元} \times 7.30\% = 730 \text{ 美元}$$

● 第 3 期期間（1999/8/1~2000/7/31）， $h = 3$

假設第 3 觀察期（1999/8/1~2000/7/31）之 [10]CMS<sub>3</sub><sup>d</sup>、[2]CMS<sub>3</sub><sup>d</sup> 及兩者差異 Spread<sub>3</sub><sup>d</sup> 每日變化如下表：

| d  | 評價日       | [10]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>3</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日        | [10]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>3</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [10]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>3</sub> <sup>d</sup> |
|----|-----------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|------------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 1  | 1999/8/1  | 6.90%                             | 6.27%                            | 0.63%                            | 93  | 1999/11/1  | 6.92%                             | 6.38%                            | 0.54%                            | 185 | 2000/2/1  | 7.44%                             | 7.13%                            | 0.31%                            |
| 2  | 1999/8/2  | 6.94%                             | 6.33%                            | 0.61%                            | 94  | 1999/11/2  | 6.89%                             | 6.37%                            | 0.52%                            | 186 | 2000/2/2  | 7.46%                             | 7.16%                            | 0.30%                            |
| 3  | 1999/8/3  | 6.99%                             | 6.34%                            | 0.65%                            | 95  | 1999/11/3  | 6.86%                             | 6.34%                            | 0.52%                            | 187 | 2000/2/3  | 7.38%                             | 7.16%                            | 0.22%                            |
| 4  | 1999/8/4  | 6.98%                             | 6.27%                            | 0.71%                            | 96  | 1999/11/4  | 6.81%                             | 6.29%                            | 0.52%                            | 188 | 2000/2/4  | 7.46%                             | 7.22%                            | 0.24%                            |
| 5  | 1999/8/5  | 6.89%                             | 6.23%                            | 0.66%                            | 97  | 1999/11/5  | 6.75%                             | 6.24%                            | 0.51%                            | 189 | 2000/2/5  | 7.46%                             | 7.22%                            | 0.24%                            |
| 6  | 1999/8/6  | 7.09%                             | 6.41%                            | 0.68%                            | 98  | 1999/11/6  | 6.75%                             | 6.24%                            | 0.51%                            | 190 | 2000/2/6  | 7.46%                             | 7.22%                            | 0.24%                            |
| 7  | 1999/8/7  | 7.09%                             | 6.41%                            | 0.68%                            | 99  | 1999/11/7  | 6.75%                             | 6.24%                            | 0.51%                            | 191 | 2000/2/7  | 7.51%                             | 7.23%                            | 0.28%                            |
| 8  | 1999/8/8  | 7.09%                             | 6.41%                            | 0.68%                            | 100 | 1999/11/8  | 6.76%                             | 6.23%                            | 0.53%                            | 192 | 2000/2/8  | 7.45%                             | 7.21%                            | 0.24%                            |
| 9  | 1999/8/9  | 7.20%                             | 6.49%                            | 0.71%                            | 101 | 1999/11/9  | 6.78%                             | 6.25%                            | 0.53%                            | 193 | 2000/2/9  | 7.51%                             | 7.19%                            | 0.32%                            |
| 10 | 1999/8/10 | 7.22%                             | 6.52%                            | 0.70%                            | 102 | 1999/11/10 | 6.82%                             | 6.33%                            | 0.49%                            | 194 | 2000/2/10 | 7.61%                             | 7.19%                            | 0.42%                            |
| 11 | 1999/8/11 | 7.16%                             | 6.47%                            | 0.69%                            | 103 | 1999/11/11 | 6.72%                             | 6.32%                            | 0.40%                            | 195 | 2000/2/11 | 7.53%                             | 7.14%                            | 0.39%                            |
| 12 | 1999/8/12 | 7.15%                             | 6.43%                            | 0.72%                            | 104 | 1999/11/12 | 6.71%                             | 6.28%                            | 0.43%                            | 196 | 2000/2/12 | 7.53%                             | 7.14%                            | 0.39%                            |
| 13 | 1999/8/13 | 7.03%                             | 6.37%                            | 0.66%                            | 105 | 1999/11/13 | 6.71%                             | 6.28%                            | 0.43%                            | 197 | 2000/2/13 | 7.53%                             | 7.14%                            | 0.39%                            |
| 14 | 1999/8/14 | 7.03%                             | 6.37%                            | 0.66%                            | 106 | 1999/11/14 | 6.71%                             | 6.28%                            | 0.43%                            | 198 | 2000/2/14 | 7.51%                             | 7.15%                            | 0.36%                            |

| d  | 評價日        | [10]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | Spread <sup>d</sup> | d   | 評價日        | [10]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | Spread <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [10]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | Spread <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [10]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | Spread <sup>d</sup> |
|----|------------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|-----|------------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|-----|-----------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|-----|-----------|-----------------------------------|----------------------------------|---------------------|
| 15 | 1999/8/15  | 7.03%                             | 6.37%                            | 0.66%               | 107 | 1999/11/15 | 6.73%                             | 6.28%                            | 0.45%               | 199 | 2000/2/15 | 7.53%                             | 7.16%                            | 0.37%               | 291 | 2000/5/17 | 7.82%                             | 7.67%                            | 0.15%               |
| 16 | 1999/8/16  | 6.96%                             | 6.34%                            | 0.62%               | 108 | 1999/11/16 | 6.74%                             | 6.34%                            | 0.40%               | 200 | 2000/2/16 | 7.55%                             | 7.17%                            | 0.38%               | 292 | 2000/5/18 | 7.87%                             | 7.66%                            | 0.21%               |
| 17 | 1999/8/17  | 6.85%                             | 6.27%                            | 0.58%               | 109 | 1999/11/17 | 6.81%                             | 6.38%                            | 0.43%               | 201 | 2000/2/17 | 7.56%                             | 7.23%                            | 0.33%               | 293 | 2000/5/19 | 7.82%                             | 7.61%                            | 0.21%               |
| 18 | 1999/8/18  | 6.85%                             | 6.22%                            | 0.63%               | 110 | 1999/11/18 | 6.83%                             | 6.40%                            | 0.43%               | 202 | 2000/2/18 | 7.51%                             | 7.22%                            | 0.29%               | 294 | 2000/5/20 | 7.82%                             | 7.61%                            | 0.21%               |
| 19 | 1999/8/19  | 6.85%                             | 6.24%                            | 0.61%               | 111 | 1999/11/19 | 6.86%                             | 6.39%                            | 0.47%               | 203 | 2000/2/19 | 7.51%                             | 7.22%                            | 0.29%               | 295 | 2000/5/21 | 7.82%                             | 7.61%                            | 0.21%               |
| 20 | 1999/8/20  | 6.92%                             | 6.23%                            | 0.69%               | 112 | 1999/11/20 | 6.86%                             | 6.39%                            | 0.47%               | 204 | 2000/2/20 | 7.51%                             | 7.22%                            | 0.29%               | 296 | 2000/5/22 | 7.77%                             | 7.58%                            | 0.19%               |
| 21 | 1999/8/21  | 6.92%                             | 6.23%                            | 0.69%               | 113 | 1999/11/21 | 6.86%                             | 6.39%                            | 0.47%               | 205 | 2000/2/21 | 7.51%                             | 7.22%                            | 0.29%               | 297 | 2000/5/23 | 7.77%                             | 7.60%                            | 0.17%               |
| 22 | 1999/8/22  | 6.92%                             | 6.23%                            | 0.69%               | 114 | 1999/11/22 | 6.81%                             | 6.37%                            | 0.44%               | 206 | 2000/2/22 | 7.40%                             | 7.13%                            | 0.27%               | 298 | 2000/5/24 | 7.76%                             | 7.60%                            | 0.16%               |
| 23 | 1999/8/23  | 6.94%                             | 6.24%                            | 0.70%               | 115 | 1999/11/23 | 6.80%                             | 6.35%                            | 0.45%               | 207 | 2000/2/23 | 7.45%                             | 7.16%                            | 0.29%               | 299 | 2000/5/25 | 7.70%                             | 7.56%                            | 0.14%               |
| 24 | 1999/8/24  | 6.84%                             | 6.20%                            | 0.64%               | 116 | 1999/11/24 | 6.89%                             | 6.48%                            | 0.41%               | 208 | 2000/2/24 | 7.40%                             | 7.10%                            | 0.30%               | 300 | 2000/5/26 | 7.64%                             | 7.52%                            | 0.12%               |
| 25 | 1999/8/25  | 6.74%                             | 6.13%                            | 0.61%               | 117 | 1999/11/25 | 6.89%                             | 6.48%                            | 0.41%               | 209 | 2000/2/25 | 7.38%                             | 6.97%                            | 0.41%               | 301 | 2000/5/27 | 7.64%                             | 7.52%                            | 0.12%               |
| 26 | 1999/8/26  | 6.76%                             | 6.18%                            | 0.58%               | 118 | 1999/11/26 | 6.93%                             | 6.51%                            | 0.42%               | 210 | 2000/2/26 | 7.38%                             | 6.97%                            | 0.41%               | 302 | 2000/5/28 | 7.64%                             | 7.52%                            | 0.12%               |
| 27 | 1999/8/27  | 6.88%                             | 6.26%                            | 0.62%               | 119 | 1999/11/27 | 6.93%                             | 6.51%                            | 0.42%               | 211 | 2000/2/27 | 7.38%                             | 6.97%                            | 0.41%               | 303 | 2000/5/29 | 7.64%                             | 7.53%                            | 0.11%               |
| 28 | 1999/8/28  | 6.88%                             | 6.26%                            | 0.62%               | 120 | 1999/11/28 | 6.93%                             | 6.51%                            | 0.42%               | 212 | 2000/2/28 | 7.45%                             | 7.07%                            | 0.38%               | 304 | 2000/5/30 | 7.71%                             | 7.61%                            | 0.10%               |
| 29 | 1999/8/29  | 6.88%                             | 6.26%                            | 0.62%               | 121 | 1999/11/29 | 7.02%                             | 6.50%                            | 0.52%               | 213 | 2000/2/29 | 7.42%                             | 7.07%                            | 0.35%               | 305 | 2000/5/31 | 7.63%                             | 7.54%                            | 0.09%               |
| 30 | 1999/8/30  | 6.97%                             | 6.33%                            | 0.64%               | 122 | 1999/11/30 | 6.99%                             | 6.47%                            | 0.52%               | 214 | 2000/3/1  | 7.40%                             | 7.06%                            | 0.34%               | 306 | 2000/6/1  | 7.49%                             | 7.46%                            | 0.03%               |
| 31 | 1999/8/31  | 6.99%                             | 6.37%                            | 0.62%               | 123 | 1999/12/1  | 6.90%                             | 6.55%                            | 0.35%               | 215 | 2000/3/2  | 7.39%                             | 7.05%                            | 0.34%               | 307 | 2000/6/2  | 7.41%                             | 7.35%                            | 0.06%               |
| 32 | 1999/9/1   | 7.02%                             | 6.36%                            | 0.66%               | 124 | 1999/12/2  | 7.04%                             | 6.60%                            | 0.44%               | 216 | 2000/3/3  | 7.37%                             | 7.04%                            | 0.33%               | 308 | 2000/6/3  | 7.41%                             | 7.35%                            | 0.06%               |
| 33 | 1999/9/2   | 7.09%                             | 6.38%                            | 0.71%               | 125 | 1999/12/3  | 6.87%                             | 6.54%                            | 0.33%               | 217 | 2000/3/4  | 7.37%                             | 7.04%                            | 0.33%               | 309 | 2000/6/4  | 7.41%                             | 7.35%                            | 0.06%               |
| 34 | 1999/9/3   | 6.96%                             | 6.27%                            | 0.69%               | 126 | 1999/12/4  | 6.87%                             | 6.54%                            | 0.33%               | 218 | 2000/3/5  | 7.37%                             | 7.04%                            | 0.33%               | 310 | 2000/6/5  | 7.31%                             | 7.28%                            | 0.03%               |
| 35 | 1999/9/4   | 6.96%                             | 6.27%                            | 0.69%               | 127 | 1999/12/5  | 6.87%                             | 6.54%                            | 0.33%               | 219 | 2000/3/6  | 7.37%                             | 7.06%                            | 0.31%               | 311 | 2000/6/6  | 7.33%                             | 7.28%                            | 0.05%               |
| 36 | 1999/9/5   | 6.96%                             | 6.27%                            | 0.69%               | 128 | 1999/12/6  | 6.93%                             | 6.44%                            | 0.49%               | 220 | 2000/3/7  | 7.39%                             | 7.05%                            | 0.34%               | 312 | 2000/6/7  | 7.40%                             | 7.35%                            | 0.05%               |
| 37 | 1999/9/6   | 6.97%                             | 6.28%                            | 0.69%               | 129 | 1999/12/7  | 6.90%                             | 6.51%                            | 0.39%               | 221 | 2000/3/8  | 7.40%                             | 7.06%                            | 0.34%               | 313 | 2000/6/8  | 7.41%                             | 7.37%                            | 0.04%               |
| 38 | 1999/9/7   | 7.03%                             | 6.34%                            | 0.69%               | 130 | 1999/12/8  | 6.94%                             | 6.53%                            | 0.41%               | 222 | 2000/3/9  | 7.38%                             | 7.06%                            | 0.32%               | 314 | 2000/6/9  | 7.40%                             | 7.36%                            | 0.04%               |
| 39 | 1999/9/8   | 6.97%                             | 6.30%                            | 0.67%               | 131 | 1999/12/9  | 6.93%                             | 6.51%                            | 0.42%               | 223 | 2000/3/10 | 7.43%                             | 7.11%                            | 0.32%               | 315 | 2000/6/10 | 7.40%                             | 7.36%                            | 0.04%               |
| 40 | 1999/9/9   | 6.99%                             | 6.32%                            | 0.67%               | 132 | 1999/12/10 | 6.88%                             | 6.48%                            | 0.40%               | 224 | 2000/3/11 | 7.43%                             | 7.11%                            | 0.32%               | 316 | 2000/6/11 | 7.40%                             | 7.36%                            | 0.04%               |
| 41 | 1999/9/10  | 6.89%                             | 6.26%                            | 0.63%               | 133 | 1999/12/11 | 6.88%                             | 6.48%                            | 0.40%               | 225 | 2000/3/12 | 7.43%                             | 7.11%                            | 0.32%               | 317 | 2000/6/12 | 7.33%                             | 7.30%                            | 0.03%               |
| 42 | 1999/9/11  | 6.89%                             | 6.26%                            | 0.63%               | 134 | 1999/12/12 | 6.88%                             | 6.48%                            | 0.40%               | 226 | 2000/3/13 | 7.44%                             | 7.10%                            | 0.34%               | 318 | 2000/6/13 | 7.34%                             | 7.27%                            | 0.07%               |
| 43 | 1999/9/12  | 6.89%                             | 6.26%                            | 0.63%               | 135 | 1999/12/13 | 6.93%                             | 6.52%                            | 0.41%               | 227 | 2000/3/14 | 7.40%                             | 7.08%                            | 0.32%               | 319 | 2000/6/14 | 7.28%                             | 7.18%                            | 0.10%               |
| 44 | 1999/9/13  | 6.90%                             | 6.22%                            | 0.68%               | 136 | 1999/12/14 | 7.04%                             | 6.62%                            | 0.42%               | 228 | 2000/3/15 | 7.41%                             | 7.10%                            | 0.31%               | 320 | 2000/6/15 | 7.25%                             | 7.24%                            | 0.01%               |
| 45 | 1999/9/14  | 6.92%                             | 6.28%                            | 0.64%               | 137 | 1999/12/15 | 7.07%                             | 6.64%                            | 0.43%               | 229 | 2000/3/16 | 7.35%                             | 7.10%                            | 0.25%               | 321 | 2000/6/16 | 7.17%                             | 7.14%                            | 0.03%               |
| 46 | 1999/9/15  | 6.81%                             | 6.13%                            | 0.68%               | 138 | 1999/12/16 | 7.14%                             | 6.72%                            | 0.42%               | 230 | 2000/3/17 | 7.28%                             | 7.08%                            | 0.20%               | 322 | 2000/6/17 | 7.17%                             | 7.14%                            | 0.03%               |
| 47 | 1999/9/16  | 6.81%                             | 6.19%                            | 0.62%               | 139 | 1999/12/17 | 7.14%                             | 6.73%                            | 0.41%               | 231 | 2000/3/18 | 7.28%                             | 7.08%                            | 0.20%               | 323 | 2000/6/18 | 7.17%                             | 7.14%                            | 0.03%               |
| 48 | 1999/9/17  | 6.80%                             | 6.17%                            | 0.63%               | 140 | 1999/12/18 | 7.14%                             | 6.73%                            | 0.41%               | 232 | 2000/3/19 | 7.28%                             | 7.08%                            | 0.20%               | 324 | 2000/6/19 | 7.19%                             | 7.18%                            | 0.01%               |
| 49 | 1999/9/18  | 6.80%                             | 6.17%                            | 0.63%               | 141 | 1999/12/19 | 7.14%                             | 6.73%                            | 0.41%               | 233 | 2000/3/20 | 7.30%                             | 7.09%                            | 0.21%               | 325 | 2000/6/20 | 7.26%                             | 7.25%                            | 0.01%               |
| 50 | 1999/9/19  | 6.80%                             | 6.17%                            | 0.63%               | 142 | 1999/12/20 | 7.19%                             | 6.78%                            | 0.41%               | 234 | 2000/3/21 | 7.27%                             | 7.08%                            | 0.19%               | 326 | 2000/6/21 | 7.35%                             | 7.29%                            | 0.06%               |
| 51 | 1999/9/20  | 6.85%                             | 6.23%                            | 0.62%               | 143 | 1999/12/21 | 7.21%                             | 6.80%                            | 0.41%               | 235 | 2000/3/22 | 7.31%                             | 7.08%                            | 0.23%               | 327 | 2000/6/22 | 7.36%                             | 7.27%                            | 0.09%               |
| 52 | 1999/9/21  | 6.87%                             | 6.22%                            | 0.65%               | 144 | 1999/12/22 | 7.19%                             | 6.78%                            | 0.41%               | 236 | 2000/3/23 | 7.25%                             | 7.10%                            | 0.15%               | 328 | 2000/6/23 | 7.40%                             | 7.30%                            | 0.10%               |
| 53 | 1999/9/22  | 6.85%                             | 6.20%                            | 0.65%               | 145 | 1999/12/23 | 7.22%                             | 6.80%                            | 0.42%               | 237 | 2000/3/24 | 7.35%                             | 7.23%                            | 0.12%               | 329 | 2000/6/24 | 7.40%                             | 7.30%                            | 0.10%               |
| 54 | 1999/9/23  | 6.73%                             | 6.13%                            | 0.60%               | 146 | 1999/12/24 | 7.22%                             | 6.80%                            | 0.42%               | 238 | 2000/3/25 | 7.35%                             | 7.23%                            | 0.12%               | 330 | 2000/6/25 | 7.40%                             | 7.30%                            | 0.10%               |
| 55 | 1999/9/24  | 6.72%                             | 6.11%                            | 0.61%               | 147 | 1999/12/25 | 7.22%                             | 6.80%                            | 0.42%               | 239 | 2000/3/26 | 7.35%                             | 7.23%                            | 0.12%               | 331 | 2000/6/26 | 7.33%                             | 7.27%                            | 0.06%               |
| 56 | 1999/9/25  | 6.72%                             | 6.11%                            | 0.61%               | 148 | 1999/12/26 | 7.22%                             | 6.80%                            | 0.42%               | 240 | 2000/3/27 | 7.36%                             | 7.25%                            | 0.11%               | 332 | 2000/6/27 | 7.31%                             | 7.25%                            | 0.06%               |
| 57 | 1999/9/26  | 6.72%                             | 6.11%                            | 0.61%               | 149 | 1999/12/27 | 7.20%                             | 6.77%                            | 0.43%               | 241 | 2000/3/28 | 7.38%                             | 7.23%                            | 0.15%               | 333 | 2000/6/28 | 7.33%                             | 7.23%                            | 0.10%               |
| 58 | 1999/9/27  | 6.75%                             | 6.14%                            | 0.61%               | 150 | 1999/12/28 | 7.21%                             | 6.79%                            | 0.42%               | 242 | 2000/3/29 | 7.41%                             | 7.23%                            | 0.18%               | 334 | 2000/6/29 | 7.27%                             | 7.19%                            | 0.08%               |
| 59 | 1999/9/28  | 6.84%                             | 6.19%                            | 0.65%               | 151 | 1999/12/29 | 7.18%                             | 6.76%                            | 0.42%               | 243 | 2000/3/30 | 7.36%                             | 7.16%                            | 0.20%               | 335 | 2000/6/30 | 7.26%                             | 7.21%                            | 0.05%               |
| 60 | 1999/9/29  | 6.93%                             | 6.22%                            | 0.71%               | 152 | 1999/12/30 | 7.17%                             | 6.75%                            | 0.42%               | 244 | 2000/3/31 | 7.27%                             | 7.16%                            | 0.11%               | 336 | 2000/7/1  | 7.26%                             | 7.21%                            | 0.05%               |
| 61 | 1999/9/30  | 6.85%                             | 6.20%                            | 0.65%               | 153 | 1999/12/31 | 7.17%                             | 6.77%                            | 0.40%               | 245 | 2000/4/1  | 7.27%                             | 7.16%                            | 0.11%               | 337 | 2000/7/2  | 7.26%                             | 7.21%                            | 0.05%               |
| 62 | 1999/10/1  | 6.92%                             | 6.31%                            | 0.61%               | 154 | 2000/1/1   | 7.17%                             | 6.77%                            | 0.40%               | 246 | 2000/4/2  | 7.27%                             | 7.16%                            | 0.11%               | 338 | 2000/7/3  | 7.21%                             | 7.15%                            | 0.06%               |
| 63 | 1999/10/2  | 6.92%                             | 6.31%                            | 0.61%               | 155 | 2000/1/2   | 7.17%                             | 6.77%                            | 0.40%               | 247 | 2000/4/3  | 7.23%                             | 7.11%                            | 0.12%               | 339 | 2000/7/4  | 7.21%                             | 7.11%                            | 0.10%               |
| 64 | 1999/10/3  | 6.92%                             | 6.31%                            | 0.61%               | 156 | 2000/1/3   | 7.36%                             | 6.92%                            | 0.44%               | 248 | 2000/4/4  | 7.17%                             | 6.99%                            | 0.18%               | 340 | 2000/7/5  | 7.15%                             | 7.09%                            | 0.06%               |
| 65 | 1999/10/4  | 6.87%                             | 6.29%                            | 0.58%               | 157 | 2000/1/4   | 7.29%                             | 6.86%                            | 0.43%               | 249 | 2000/4/5  | 7.17%                             | 7.00%                            | 0.17%               | 341 | 2000/7/6  | 7.22%                             | 7.15%                            | 0.07%               |
| 66 | 1999/10/5  | 6.97%                             | 6.36%                            | 0.61%               | 158 | 2000/1/5   | 7.37%                             | 6.91%                            | 0.46%               | 250 | 2000/4/6  | 7.20%                             | 7.06%                            | 0.14%               | 342 | 2000/7/7  | 7.17%                             | 7.05%                            | 0.12%               |
| 67 | 1999/10/6  | 6.95%                             | 6.43%                            | 0.52%               | 159 | 2000/1/6   | 7.32%                             | 6.86%                            | 0.46%               | 251 | 2000/4/7  | 7.14%                             | 7.03%                            | 0.11%               | 343 | 2000/7/8  | 7.17%                             | 7.05%                            | 0.12%               |
| 68 | 1999/10/7  | 6.95%                             | 6.43%                            | 0.52%               | 160 | 2000/1/7   | 7.27%                             | 6.85%                            | 0.42%               | 252 | 2000/4/8  | 7.14%                             | 7.03%                            | 0.11%               | 344 | 2000/7/9  | 7.17%                             | 7.05%                            | 0.12%               |
| 69 | 1999/10/8  | 6.94%                             | 6.41%                            | 0.53%               | 161 | 2000/1/8   | 7.27%                             | 6.85%                            | 0.42%               | 253 | 2000/4/9  | 7.14%                             | 7.03%                            | 0.11%               | 345 | 2000/7/10 | 7.20%                             | 7.10%                            | 0.10%               |
| 70 | 1999/10/9  | 6.94%                             | 6.41%                            | 0.53%               | 162 | 2000/1/9   | 7.27%                             | 6.85%                            | 0.42%               | 254 | 2000/4/10 | 7.15%                             | 6.98%                            | 0.17%               | 346 | 2000/7/11 | 7.23%                             | 7.09%                            | 0.14%               |
| 71 | 1999/10/10 | 6.94%                             | 6.41%                            | 0.53%               | 163 | 2000/1/10  | 7.31%                             | 6.89%                            | 0.42%               | 255 | 2000/4/11 | 7.21%                             | 7.02%                            | 0.19%               | 347 | 2000/7/12 | 7.25%                             | 7.13%                            | 0.12%               |
| 72 | 1999/10/11 | 6.94%                             | 6.41%                            | 0.53%               | 164 | 2000/1/11  | 7.43%                             | 6.96%                            | 0.47%               | 256 | 2000/4/12 | 7.24%                             | 7.04%                            | 0.20%               | 348 | 2000/7/13 | 7.17%                             | 7.07%                            | 0.10%               |
| 73 | 1999/10/12 | 6.83%                             | 6.39%                            | 0.44%               | 165 | 2000/1/12  | 7.46%                             | 6.99%                            | 0.47%               | 257 | 2000/4/13 | 7.20%                             | 7.02%                            | 0.18%               | 349 | 2000/7/14 | 7.28%                             | 7.19%                            | 0.09%               |
| 74 | 1999/10/13 | 6.98%                             | 6.44%                            | 0.54%               | 166 | 2000/1/13  | 7.40%                             | 6.93%                            | 0.47%               | 258 | 2000/4/14 | 7.19%                             | 7.04%                            | 0.15%               | 350 | 2000/7/15 | 7.28%                             | 7.19%                            | 0.09%               |
| 75 | 1999/10/14 | 7.04%                             | 6.54%                            | 0.50%               | 167 | 2000/1/14  | 7.43%                             | 6.95%                            | 0.                  |     |           |                                   |                                  |                     |     |           |                                   |                                  |                     |

| d  | 評價日        | [1]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>3</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [1]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>3</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [1]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>3</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [1]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>3</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>3</sub> <sup>d</sup> |
|----|------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 81 | 1999/10/20 | 7.06%                            | 6.46%                            | 0.60%                            | 173 | 2000/1/20 | 7.52%                            | 7.00%                            | 0.52%                            | 265 | 2000/4/21 | 7.21%                            | 7.03%                            | 0.18%                            | 357 | 2000/7/22 | 7.20%                            | 7.07%                            | 0.13%                            |
| 82 | 1999/10/21 | 7.00%                            | 6.54%                            | 0.46%                            | 174 | 2000/1/21 | 7.48%                            | 6.95%                            | 0.53%                            | 266 | 2000/4/22 | 7.21%                            | 7.03%                            | 0.18%                            | 358 | 2000/7/23 | 7.20%                            | 7.07%                            | 0.13%                            |
| 83 | 1999/10/22 | 7.07%                            | 6.51%                            | 0.56%                            | 175 | 2000/1/22 | 7.48%                            | 6.95%                            | 0.53%                            | 267 | 2000/4/23 | 7.21%                            | 7.03%                            | 0.18%                            | 359 | 2000/7/24 | 7.24%                            | 7.10%                            | 0.14%                            |
| 84 | 1999/10/23 | 7.07%                            | 6.51%                            | 0.56%                            | 176 | 2000/1/23 | 7.48%                            | 6.95%                            | 0.53%                            | 268 | 2000/4/24 | 7.24%                            | 7.06%                            | 0.18%                            | 360 | 2000/7/25 | 7.23%                            | 7.07%                            | 0.16%                            |
| 85 | 1999/10/24 | 7.07%                            | 6.51%                            | 0.56%                            | 177 | 2000/1/24 | 7.40%                            | 6.91%                            | 0.49%                            | 269 | 2000/4/25 | 7.32%                            | 7.14%                            | 0.18%                            | 361 | 2000/7/26 | 7.22%                            | 7.09%                            | 0.13%                            |
| 86 | 1999/10/25 | 7.10%                            | 6.54%                            | 0.56%                            | 178 | 2000/1/25 | 7.39%                            | 6.93%                            | 0.46%                            | 270 | 2000/4/26 | 7.33%                            | 7.14%                            | 0.19%                            | 362 | 2000/7/27 | 7.17%                            | 7.07%                            | 0.10%                            |
| 87 | 1999/10/26 | 7.10%                            | 6.49%                            | 0.61%                            | 179 | 2000/1/26 | 7.37%                            | 6.94%                            | 0.43%                            | 271 | 2000/4/27 | 7.42%                            | 7.26%                            | 0.16%                            | 363 | 2000/7/28 | 7.26%                            | 7.10%                            | 0.16%                            |
| 88 | 1999/10/27 | 7.08%                            | 6.55%                            | 0.53%                            | 180 | 2000/1/27 | 7.42%                            | 7.01%                            | 0.41%                            | 272 | 2000/4/28 | 7.40%                            | 7.32%                            | 0.08%                            | 364 | 2000/7/29 | 7.26%                            | 7.10%                            | 0.16%                            |
| 89 | 1999/10/28 | 6.99%                            | 6.48%                            | 0.51%                            | 181 | 2000/1/28 | 7.45%                            | 7.09%                            | 0.36%                            | 273 | 2000/4/29 | 7.40%                            | 7.32%                            | 0.08%                            | 365 | 2000/7/30 | 7.26%                            | 7.10%                            | 0.16%                            |
| 90 | 1999/10/29 | 6.86%                            | 6.36%                            | 0.50%                            | 182 | 2000/1/29 | 7.45%                            | 7.09%                            | 0.36%                            | 274 | 2000/4/30 | 7.40%                            | 7.32%                            | 0.08%                            | 366 | 2000/7/31 | 7.25%                            | 7.11%                            | 0.14%                            |
| 91 | 1999/10/30 | 6.86%                            | 6.36%                            | 0.50%                            | 183 | 2000/1/30 | 7.45%                            | 7.09%                            | 0.36%                            | 275 | 2000/5/1  | 7.46%                            | 7.36%                            | 0.10%                            |     |           |                                  |                                  |                                  |
| 92 | 1999/10/31 | 6.86%                            | 6.36%                            | 0.50%                            | 184 | 2000/1/31 | 7.51%                            | 7.15%                            | 0.36%                            | 276 | 2000/5/2  | 7.50%                            | 7.34%                            | 0.16%                            |     |           |                                  |                                  |                                  |

註：1.該日非 CMS 報價日時，其利率以前一報價日之利率計算。

2.觀察日後之利率（2000/7/26 至 2000/7/31）以觀察日之利率估算。

則  $G_3$  = 第 3 觀察期期間內，所有結構型債券評價日之日數（即上表所列日數）= 366(日)

$g_3$  = 第 3 觀察期期間內， $Spread_3^d$  落在規定區間 0%~1.00% 內之日數合計（即上表所列陰影區域之日數）= 366(日)

第 3 期之收益分配率為

$$R_3 = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 7\% + 100\% \times Portfolio_3 \right) \times \frac{g_3}{G_3}, 1\% \right], 10\% \right\} = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 7\% + 100\% \times 0.16\% \right) \times \frac{366}{366}, 1\% \right], 10\% \right\}$$

$$= \text{Min} \{ \text{Max} ( 7.16\%, 1\% ), 10\% \} = 7.16\%$$

$$\text{收益分配} = 10,000 \text{ 美元} \times 7.16\% = 716 \text{ 美元}$$

.....

● 第 7 期期間（2003/8/1~2004/7/31）， $h = 7$ （最後一期）

假設第 7 觀察期（2003/8/1~2004/7/31）之 [1]CMS<sub>7</sub><sup>d</sup>、[2]CMS<sub>7</sub><sup>d</sup> 及兩者差異 Spread<sub>7</sub><sup>d</sup> 每日變化如下表：

| d  | 評價日       | [1]CMS <sub>7</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>7</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>7</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日        | [1]CMS <sub>7</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>7</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>7</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [1]CMS <sub>7</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>7</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>7</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [1]CMS <sub>7</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>7</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>7</sub> <sup>d</sup> |
|----|-----------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 1  | 2003/8/1  | 5.12%                            | 2.23%                            | 2.89%                            | 93  | 2003/11/1  | 4.72%                            | 2.19%                            | 2.53%                            | 185 | 2004/2/1  | 4.55%                            | 2.18%                            | 2.37%                            | 277 | 2004/5/3  | 4.98%                            | 2.68%                            | 2.30%                            |
| 2  | 2003/8/2  | 5.12%                            | 2.23%                            | 2.89%                            | 94  | 2003/11/2  | 4.72%                            | 2.19%                            | 2.53%                            | 186 | 2004/2/2  | 4.54%                            | 2.15%                            | 2.39%                            | 278 | 2004/5/4  | 5.00%                            | 2.66%                            | 2.34%                            |
| 3  | 2003/8/3  | 5.12%                            | 2.23%                            | 2.89%                            | 95  | 2003/11/3  | 4.81%                            | 2.28%                            | 2.53%                            | 187 | 2004/2/3  | 4.51%                            | 2.11%                            | 2.40%                            | 279 | 2004/5/5  | 5.08%                            | 2.67%                            | 2.41%                            |
| 4  | 2003/8/4  | 5.02%                            | 2.14%                            | 2.88%                            | 96  | 2003/11/4  | 4.73%                            | 2.20%                            | 2.53%                            | 188 | 2004/2/4  | 4.53%                            | 2.12%                            | 2.41%                            | 280 | 2004/5/6  | 5.13%                            | 2.73%                            | 2.40%                            |
| 5  | 2003/8/5  | 4.97%                            | 2.16%                            | 2.81%                            | 97  | 2003/11/5  | 4.74%                            | 2.22%                            | 2.52%                            | 189 | 2004/2/5  | 4.54%                            | 2.15%                            | 2.39%                            | 281 | 2004/5/7  | 5.31%                            | 2.99%                            | 2.32%                            |
| 6  | 2003/8/6  | 4.89%                            | 2.12%                            | 2.77%                            | 98  | 2003/11/6  | 4.82%                            | 2.33%                            | 2.49%                            | 190 | 2004/2/6  | 4.49%                            | 2.09%                            | 2.40%                            | 282 | 2004/5/8  | 5.31%                            | 2.99%                            | 2.32%                            |
| 7  | 2003/8/7  | 4.80%                            | 2.08%                            | 2.72%                            | 99  | 2003/11/7  | 4.89%                            | 2.38%                            | 2.51%                            | 191 | 2004/2/7  | 4.49%                            | 2.09%                            | 2.40%                            | 283 | 2004/5/9  | 5.31%                            | 2.99%                            | 2.32%                            |
| 8  | 2003/8/8  | 4.60%                            | 1.92%                            | 2.68%                            | 100 | 2003/11/8  | 4.89%                            | 2.38%                            | 2.51%                            | 192 | 2004/2/8  | 4.49%                            | 2.09%                            | 2.40%                            | 284 | 2004/5/10 | 5.32%                            | 2.98%                            | 2.34%                            |
| 9  | 2003/8/9  | 4.60%                            | 1.92%                            | 2.68%                            | 101 | 2003/11/9  | 4.89%                            | 2.38%                            | 2.51%                            | 193 | 2004/2/9  | 4.48%                            | 2.09%                            | 2.39%                            | 285 | 2004/5/11 | 5.32%                            | 2.98%                            | 2.34%                            |
| 10 | 2003/8/10 | 4.60%                            | 1.92%                            | 2.68%                            | 102 | 2003/11/10 | 4.87%                            | 2.38%                            | 2.49%                            | 194 | 2004/2/10 | 4.51%                            | 2.14%                            | 2.37%                            | 286 | 2004/5/12 | 5.29%                            | 2.95%                            | 2.34%                            |
| 11 | 2003/8/11 | 4.81%                            | 2.07%                            | 2.74%                            | 103 | 2003/11/11 | 4.84%                            | 2.37%                            | 2.47%                            | 195 | 2004/2/11 | 4.42%                            | 2.03%                            | 2.39%                            | 287 | 2004/5/13 | 5.38%                            | 3.02%                            | 2.36%                            |
| 12 | 2003/8/12 | 4.83%                            | 2.08%                            | 2.75%                            | 104 | 2003/11/12 | 4.81%                            | 2.35%                            | 2.46%                            | 196 | 2004/2/12 | 4.44%                            | 2.04%                            | 2.40%                            | 288 | 2004/5/14 | 5.30%                            | 2.95%                            | 2.35%                            |
| 13 | 2003/8/13 | 5.04%                            | 2.11%                            | 2.93%                            | 105 | 2003/11/13 | 4.76%                            | 2.27%                            | 2.49%                            | 197 | 2004/2/13 | 4.44%                            | 2.00%                            | 2.44%                            | 289 | 2004/5/15 | 5.30%                            | 2.95%                            | 2.35%                            |
| 14 | 2003/8/14 | 5.18%                            | 2.21%                            | 2.97%                            | 106 | 2003/11/14 | 4.65%                            | 2.18%                            | 2.47%                            | 198 | 2004/2/14 | 4.44%                            | 2.00%                            | 2.44%                            | 290 | 2004/5/16 | 5.30%                            | 2.95%                            | 2.35%                            |
| 15 | 2003/8/15 | 4.99%                            | 2.10%                            | 2.89%                            | 107 | 2003/11/15 | 4.65%                            | 2.18%                            | 2.47%                            | 199 | 2004/2/15 | 4.44%                            | 2.00%                            | 2.44%                            | 291 | 2004/5/17 | 5.22%                            | 2.87%                            | 2.35%                            |
| 16 | 2003/8/16 | 4.99%                            | 2.10%                            | 2.89%                            | 108 | 2003/11/16 | 4.65%                            | 2.18%                            | 2.47%                            | 200 | 2004/2/16 | 4.43%                            | 2.00%                            | 2.43%                            | 292 | 2004/5/18 | 5.22%                            | 2.93%                            | 2.29%                            |
| 17 | 2003/8/17 | 4.99%                            | 2.10%                            | 2.89%                            | 109 | 2003/11/17 | 4.59%                            | 2.11%                            | 2.48%                            | 201 | 2004/2/17 | 4.42%                            | 2.00%                            | 2.42%                            | 293 | 2004/5/19 | 5.28%                            | 2.98%                            | 2.30%                            |
| 18 | 2003/8/18 | 4.97%                            | 2.13%                            | 2.84%                            | 110 | 2003/11/18 | 4.59%                            | 2.16%                            | 2.43%                            | 202 | 2004/2/18 | 4.40%                            | 1.98%                            | 2.42%                            | 294 | 2004/5/20 | 5.23%                            | 2.96%                            | 2.27%                            |
| 19 | 2003/8/19 | 4.86%                            | 2.08%                            | 2.78%                            | 111 | 2003/11/19 | 4.59%                            | 2.16%                            | 2.43%                            | 203 | 2004/2/19 | 4.43%                            | 2.00%                            | 2.43%                            | 295 | 2004/5/21 | 5.24%                            | 2.97%                            | 2.27%                            |
| 20 | 2003/8/20 | 4.87%                            | 2.07%                            | 2.80%                            | 112 | 2003/11/20 | 4.60%                            | 2.20%                            | 2.40%                            | 204 | 2004/2/20 | 4.48%                            | 2.04%                            | 2.44%                            | 296 | 2004/5/22 | 5.24%                            | 2.97%                            | 2.27%                            |
| 21 | 2003/8/21 | 4.99%                            | 2.22%                            | 2.77%                            | 113 | 2003/11/21 | 4.52%                            | 2.14%                            | 2.38%                            | 205 | 2004/2/21 | 4.48%                            | 2.04%                            | 2.44%                            | 297 | 2004/5/23 | 5.24%                            | 2.97%                            | 2.27%                            |
| 22 | 2003/8/22 | 4.94%                            | 2.25%                            | 2.69%                            | 114 | 2003/11/22 | 4.52%                            | 2.14%                            | 2.38%                            | 206 | 2004/2/22 | 4.48%                            | 2.04%                            | 2.44%                            | 298 | 2004/5/24 | 5.23%                            | 2.98%                            | 2.25%                            |
| 23 | 2003/8/23 | 4.94%                            | 2.25%                            | 2.69%                            | 115 | 2003/11/23 | 4.52%                            | 2.14%                            | 2.38%                            | 207 | 2004/2/23 | 4.47%                            | 2.03%                            | 2.44%                            | 299 | 2004/5/25 | 5.22%                            | 2.98%                            | 2.25%                            |
| 24 | 2003/8/24 | 4.94%                            | 2.25%                            | 2.69%                            | 116 | 2003/11/24 | 4.63%                            | 2.22%                            | 2.41%                            | 208 | 2004/2/24 | 4.40%                            | 1.98%                            | 2.42%                            | 300 | 2004/5/26 | 5.19%                            | 2.94%                            | 2.25%                            |
| 25 | 2003/8/25 | 5.02%                            | 2.30%                            | 2.72%                            | 117 | 2003/11/25 | 4.56%                            | 2.19%                            | 2.37%                            | 209 | 2004/2/25 | 4.41%                            | 1.99%                            | 2.42%                            | 301 | 2004/5/27 | 5.10%                            | 2.86%                            | 2.24%                            |
| 26 | 2003/8/26 | 5.01%                            | 2.26%                            | 2.75%                            | 118 | 2003/11/26 | 4.63%                            | 2.28%                            | 2.35%                            | 210 | 2004/2/26 | 4.45%                            | 2.00%                            | 2.45%                            | 302 | 2004/5/28 | 5.13%                            | 2.92%                            | 2.21%                            |
| 27 | 2003/8/27 | 5.03%                            | 2.28%                            | 2.75%                            | 119 | 2003/11/27 | 4.63%                            | 2.35%                            | 2.28%                            | 211 | 2004/2/27 | 4.40%                            | 1.98%                            | 2.42%                            | 303 | 2004/5/29 | 5.13%                            | 2.92%                            | 2.21%                            |
| 28 | 2003/8/28 | 4.95%                            | 2.20%                            | 2.75%                            | 120 | 2003/11/28 | 4.71%                            | 2.35%                            | 2.36%                            | 212 | 2004/2/28 | 4.40%                            | 1.98%                            | 2.42%                            | 304 | 2004/5/30 | 5.13%                            | 2.92%                            | 2.21%                            |
| 29 | 2003/8/29 | 4.96%                            | 2.24%                            | 2.72%                            | 121 | 2003/11/29 | 4.71%                            | 2.35%                            | 2.36%                            | 213 | 2004/2/29 | 4.40%                            | 1.98%                            | 2.42%                            | 305 | 2004/5/31 | 5.14%                            | 2.94%                            | 2.20%                            |
| 30 | 2003/8/30 | 4.96%                            | 2.24%                            | 2.72%                            | 122 | 2003/11/30 | 4.71%                            | 2.35%                            | 2.36%                            | 214 | 2004/3/1  | 4.39%                            | 2.00%                            | 2.39%                            | 306 | 2004/6/1  | 5.21%                            | 3.00%                            | 2.21%                            |
| 31 | 2003/8/31 | 4.96%                            | 2.24%                            | 2.72%                            | 123 | 2003/12/1  | 4.82%                            | 2.43%                            | 2.39%                            | 215 | 2004/3/2  | 4.46%                            | 2.05%                            | 2.41%                            | 307 | 2004/6/2  | 5.19%                            | 3.01%                            | 2.18%                            |
| 32 | 2003/9/1  | 4.98%                            | 2.26%                            | 2.72%                            | 124 | 2003/12/2  | 4.81%                            | 2.43%                            | 2.38%                            | 216 | 2004/3/3  | 4.49%                            | 2.08%                            | 2.41%                            | 308 | 2004/6/3  | 5.21%                            | 3.02%                            | 2.19%                            |
| 33 | 2003/9/2  | 5.07%                            | 2.34%                            | 2.73%                            | 125 | 2003/12/3  | 4.80%                            | 2.41%                            | 2.39%                            | 217 | 2004/3/4  | 4.43%                            | 2.04%                            | 2.39%                            | 309 | 2004/6/4  | 5.24%                            | 3.09%                            | 2.15%                            |

| d  | 評價日        | [1]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>t</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日        | [1]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>t</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [1]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>t</sub> <sup>d</sup> | d   | 評價日       | [1]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | [2]CMS <sub>t</sub> <sup>d</sup> | Spread <sub>t</sub> <sup>d</sup> | d |
|----|------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|------------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----|-----------|----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|---|
| 34 | 2003/9/3   | 5.11%                            | 2.34%                            | 2.77%                            | 126 | 2003/12/4  | 4.78%                            | 2.40%                            | 2.38%                            | 218 | 2004/3/5  | 4.23%                            | 1.85%                            | 2.38%                            | 310 | 2004/6/5  | 5.24%                            | 3.09%                            | 2.15%                            |   |
| 35 | 2003/9/4   | 5.03%                            | 2.24%                            | 2.79%                            | 127 | 2003/12/5  | 4.61%                            | 2.20%                            | 2.41%                            | 219 | 2004/3/6  | 4.23%                            | 1.85%                            | 2.38%                            | 311 | 2004/6/6  | 5.24%                            | 3.09%                            | 2.15%                            |   |
| 36 | 2003/9/5   | 4.88%                            | 2.06%                            | 2.82%                            | 128 | 2003/12/6  | 4.61%                            | 2.20%                            | 2.41%                            | 220 | 2004/3/7  | 4.23%                            | 1.85%                            | 2.38%                            | 312 | 2004/6/7  | 5.26%                            | 3.06%                            | 2.20%                            |   |
| 37 | 2003/9/6   | 4.88%                            | 2.06%                            | 2.82%                            | 129 | 2003/12/7  | 4.61%                            | 2.20%                            | 2.41%                            | 221 | 2004/3/8  | 4.18%                            | 1.82%                            | 2.36%                            | 313 | 2004/6/8  | 5.28%                            | 3.11%                            | 2.17%                            |   |
| 38 | 2003/9/7   | 4.88%                            | 2.06%                            | 2.82%                            | 130 | 2003/12/8  | 4.66%                            | 2.24%                            | 2.42%                            | 222 | 2004/3/9  | 4.10%                            | 1.78%                            | 2.32%                            | 314 | 2004/6/9  | 5.29%                            | 3.16%                            | 2.13%                            |   |
| 39 | 2003/9/8   | 4.74%                            | 1.95%                            | 2.79%                            | 131 | 2003/12/9  | 4.62%                            | 2.23%                            | 2.39%                            | 223 | 2004/3/10 | 4.08%                            | 1.80%                            | 2.28%                            | 315 | 2004/6/10 | 5.32%                            | 3.22%                            | 2.10%                            |   |
| 40 | 2003/9/9   | 4.89%                            | 2.06%                            | 2.83%                            | 132 | 2003/12/10 | 4.72%                            | 2.27%                            | 2.45%                            | 224 | 2004/3/11 | 4.10%                            | 1.81%                            | 2.29%                            | 316 | 2004/6/11 | 5.28%                            | 3.20%                            | 2.08%                            |   |
| 41 | 2003/9/10  | 4.77%                            | 1.99%                            | 2.78%                            | 133 | 2003/12/11 | 4.70%                            | 2.25%                            | 2.45%                            | 225 | 2004/3/12 | 4.09%                            | 1.80%                            | 2.29%                            | 317 | 2004/6/12 | 5.28%                            | 3.20%                            | 2.08%                            |   |
| 42 | 2003/9/11  | 4.75%                            | 2.00%                            | 2.75%                            | 134 | 2003/12/12 | 4.58%                            | 2.11%                            | 2.47%                            | 226 | 2004/3/13 | 4.09%                            | 1.80%                            | 2.29%                            | 318 | 2004/6/13 | 5.28%                            | 3.20%                            | 2.08%                            |   |
| 43 | 2003/9/12  | 4.64%                            | 1.90%                            | 2.75%                            | 135 | 2003/12/13 | 4.58%                            | 2.11%                            | 2.47%                            | 227 | 2004/3/14 | 4.09%                            | 1.80%                            | 2.29%                            | 319 | 2004/6/14 | 5.33%                            | 3.32%                            | 2.01%                            |   |
| 44 | 2003/9/13  | 4.64%                            | 1.90%                            | 2.75%                            | 136 | 2003/12/14 | 4.58%                            | 2.11%                            | 2.47%                            | 228 | 2004/3/15 | 4.15%                            | 1.85%                            | 2.30%                            | 320 | 2004/6/15 | 5.18%                            | 3.15%                            | 2.03%                            |   |
| 45 | 2003/9/14  | 4.64%                            | 1.90%                            | 2.75%                            | 137 | 2003/12/15 | 4.60%                            | 2.13%                            | 2.47%                            | 229 | 2004/3/16 | 4.16%                            | 1.87%                            | 2.29%                            | 321 | 2004/6/16 | 5.21%                            | 3.20%                            | 2.01%                            |   |
| 46 | 2003/9/15  | 4.70%                            | 1.91%                            | 2.79%                            | 138 | 2003/12/16 | 4.62%                            | 2.15%                            | 2.47%                            | 230 | 2004/3/17 | 4.07%                            | 1.80%                            | 2.27%                            | 322 | 2004/6/17 | 5.20%                            | 3.21%                            | 1.99%                            |   |
| 47 | 2003/9/16  | 4.73%                            | 1.92%                            | 2.81%                            | 139 | 2003/12/17 | 4.52%                            | 2.09%                            | 2.43%                            | 231 | 2004/3/18 | 4.11%                            | 1.83%                            | 2.28%                            | 323 | 2004/6/18 | 5.19%                            | 3.19%                            | 2.00%                            |   |
| 48 | 2003/9/17  | 4.61%                            | 1.86%                            | 2.75%                            | 140 | 2003/12/18 | 4.54%                            | 2.17%                            | 2.37%                            | 232 | 2004/3/19 | 4.15%                            | 1.83%                            | 2.32%                            | 324 | 2004/6/19 | 5.19%                            | 3.19%                            | 2.00%                            |   |
| 49 | 2003/9/18  | 4.64%                            | 1.95%                            | 2.69%                            | 141 | 2003/12/19 | 4.55%                            | 2.14%                            | 2.41%                            | 233 | 2004/3/20 | 4.15%                            | 1.83%                            | 2.32%                            | 325 | 2004/6/20 | 5.19%                            | 3.19%                            | 2.00%                            |   |
| 50 | 2003/9/19  | 4.57%                            | 1.96%                            | 2.61%                            | 142 | 2003/12/20 | 4.55%                            | 2.14%                            | 2.41%                            | 234 | 2004/3/21 | 4.15%                            | 1.83%                            | 2.32%                            | 326 | 2004/6/21 | 5.17%                            | 3.16%                            | 2.01%                            |   |
| 51 | 2003/9/20  | 4.57%                            | 1.96%                            | 2.61%                            | 143 | 2003/12/21 | 4.55%                            | 2.14%                            | 2.41%                            | 235 | 2004/3/22 | 4.10%                            | 1.81%                            | 2.29%                            | 327 | 2004/6/22 | 5.19%                            | 3.20%                            | 1.99%                            |   |
| 52 | 2003/9/21  | 4.57%                            | 1.96%                            | 2.61%                            | 144 | 2003/12/22 | 4.56%                            | 2.18%                            | 2.38%                            | 236 | 2004/3/23 | 4.08%                            | 1.80%                            | 2.28%                            | 328 | 2004/6/23 | 5.18%                            | 3.17%                            | 2.01%                            |   |
| 53 | 2003/9/22  | 4.71%                            | 2.01%                            | 2.70%                            | 145 | 2003/12/23 | 4.63%                            | 2.23%                            | 2.40%                            | 237 | 2004/3/24 | 4.08%                            | 1.79%                            | 2.29%                            | 329 | 2004/6/24 | 5.13%                            | 3.14%                            | 1.99%                            |   |
| 54 | 2003/9/23  | 4.66%                            | 1.97%                            | 2.69%                            | 146 | 2003/12/24 | 4.58%                            | 2.16%                            | 2.42%                            | 238 | 2004/3/25 | 4.11%                            | 1.81%                            | 2.30%                            | 330 | 2004/6/25 | 5.15%                            | 3.15%                            | 2.00%                            |   |
| 55 | 2003/9/24  | 4.58%                            | 1.94%                            | 2.64%                            | 147 | 2003/12/25 | 4.58%                            | 2.15%                            | 2.43%                            | 239 | 2004/3/26 | 4.21%                            | 1.84%                            | 2.37%                            | 331 | 2004/6/26 | 5.15%                            | 3.15%                            | 2.00%                            |   |
| 56 | 2003/9/25  | 4.52%                            | 1.89%                            | 2.63%                            | 148 | 2003/12/26 | 4.55%                            | 2.13%                            | 2.42%                            | 240 | 2004/3/27 | 4.21%                            | 1.84%                            | 2.37%                            | 332 | 2004/6/27 | 5.15%                            | 3.15%                            | 2.00%                            |   |
| 57 | 2003/9/26  | 4.44%                            | 1.87%                            | 2.57%                            | 149 | 2003/12/27 | 4.55%                            | 2.13%                            | 2.42%                            | 241 | 2004/3/28 | 4.21%                            | 1.84%                            | 2.37%                            | 333 | 2004/6/28 | 5.21%                            | 3.25%                            | 1.96%                            |   |
| 58 | 2003/9/27  | 4.44%                            | 1.87%                            | 2.57%                            | 150 | 2003/12/28 | 4.55%                            | 2.13%                            | 2.42%                            | 242 | 2004/3/29 | 4.27%                            | 1.92%                            | 2.35%                            | 334 | 2004/6/29 | 5.19%                            | 3.25%                            | 1.94%                            |   |
| 59 | 2003/9/28  | 4.44%                            | 1.87%                            | 2.57%                            | 151 | 2003/12/29 | 4.61%                            | 2.15%                            | 2.46%                            | 243 | 2004/3/30 | 4.25%                            | 1.90%                            | 2.35%                            | 335 | 2004/6/30 | 5.11%                            | 3.19%                            | 1.92%                            |   |
| 60 | 2003/9/29  | 4.46%                            | 1.86%                            | 2.60%                            | 152 | 2003/12/30 | 4.70%                            | 2.18%                            | 2.52%                            | 244 | 2004/3/31 | 4.25%                            | 1.90%                            | 2.35%                            | 336 | 2004/7/1  | 5.10%                            | 3.12%                            | 1.98%                            |   |
| 61 | 2003/9/30  | 4.41%                            | 1.79%                            | 2.62%                            | 153 | 2003/12/31 | 4.66%                            | 2.15%                            | 2.51%                            | 245 | 2004/4/1  | 4.28%                            | 1.94%                            | 2.34%                            | 337 | 2004/7/2  | 4.94%                            | 2.95%                            | 1.99%                            |   |
| 62 | 2003/10/1  | 4.39%                            | 1.75%                            | 2.64%                            | 154 | 2004/1/1   | 4.65%                            | 2.16%                            | 2.49%                            | 246 | 2004/4/2  | 4.56%                            | 2.18%                            | 2.38%                            | 338 | 2004/7/3  | 4.94%                            | 2.95%                            | 1.99%                            |   |
| 63 | 2003/10/2  | 4.46%                            | 1.83%                            | 2.63%                            | 155 | 2004/1/2   | 4.77%                            | 2.27%                            | 2.50%                            | 247 | 2004/4/3  | 4.56%                            | 2.18%                            | 2.38%                            | 339 | 2004/7/4  | 4.94%                            | 2.95%                            | 1.99%                            |   |
| 64 | 2003/10/3  | 4.68%                            | 2.00%                            | 2.68%                            | 156 | 2004/1/3   | 4.77%                            | 2.27%                            | 2.50%                            | 248 | 2004/4/4  | 4.56%                            | 2.18%                            | 2.38%                            | 340 | 2004/7/5  | 4.94%                            | 2.94%                            | 2.00%                            |   |
| 65 | 2003/10/4  | 4.68%                            | 2.00%                            | 2.68%                            | 157 | 2004/1/4   | 4.77%                            | 2.27%                            | 2.50%                            | 249 | 2004/4/5  | 4.64%                            | 2.23%                            | 2.41%                            | 341 | 2004/7/6  | 4.96%                            | 2.97%                            | 1.99%                            |   |
| 66 | 2003/10/5  | 4.68%                            | 2.00%                            | 2.68%                            | 158 | 2004/1/5   | 4.77%                            | 2.26%                            | 2.50%                            | 250 | 2004/4/6  | 4.61%                            | 2.20%                            | 2.41%                            | 342 | 2004/7/7  | 4.94%                            | 2.94%                            | 2.00%                            |   |
| 67 | 2003/10/6  | 4.64%                            | 1.95%                            | 2.69%                            | 159 | 2004/1/6   | 4.64%                            | 2.16%                            | 2.48%                            | 251 | 2004/4/7  | 4.56%                            | 2.16%                            | 2.40%                            | 343 | 2004/7/8  | 4.93%                            | 2.93%                            | 2.00%                            |   |
| 68 | 2003/10/7  | 4.66%                            | 1.95%                            | 2.71%                            | 160 | 2004/1/7   | 4.64%                            | 2.15%                            | 2.49%                            | 252 | 2004/4/8  | 4.62%                            | 2.19%                            | 2.43%                            | 344 | 2004/7/9  | 4.95%                            | 2.93%                            | 2.02%                            |   |
| 69 | 2003/10/8  | 4.67%                            | 1.96%                            | 2.71%                            | 161 | 2004/1/8   | 4.63%                            | 2.16%                            | 2.47%                            | 253 | 2004/4/9  | 4.61%                            | 2.20%                            | 2.41%                            | 345 | 2004/7/10 | 4.95%                            | 2.93%                            | 2.02%                            |   |
| 70 | 2003/10/9  | 4.76%                            | 2.03%                            | 2.73%                            | 162 | 2004/1/9   | 4.50%                            | 2.01%                            | 2.49%                            | 254 | 2004/4/10 | 4.61%                            | 2.20%                            | 2.41%                            | 346 | 2004/7/11 | 4.95%                            | 2.93%                            | 2.02%                            |   |
| 71 | 2003/10/10 | 4.67%                            | 1.96%                            | 2.71%                            | 163 | 2004/1/10  | 4.50%                            | 2.01%                            | 2.49%                            | 255 | 2004/4/11 | 4.61%                            | 2.20%                            | 2.41%                            | 347 | 2004/7/12 | 4.92%                            | 2.93%                            | 1.99%                            |   |
| 72 | 2003/10/11 | 4.67%                            | 1.96%                            | 2.71%                            | 164 | 2004/1/11  | 4.50%                            | 2.01%                            | 2.49%                            | 256 | 2004/4/12 | 4.66%                            | 2.23%                            | 2.43%                            | 348 | 2004/7/13 | 4.98%                            | 3.00%                            | 1.98%                            |   |
| 73 | 2003/10/12 | 4.67%                            | 1.96%                            | 2.71%                            | 165 | 2004/1/12  | 4.42%                            | 1.95%                            | 2.47%                            | 257 | 2004/4/13 | 4.74%                            | 2.29%                            | 2.45%                            | 349 | 2004/7/14 | 4.97%                            | 3.01%                            | 1.96%                            |   |
| 74 | 2003/10/13 | 4.71%                            | 1.97%                            | 2.74%                            | 166 | 2004/1/13  | 4.44%                            | 1.95%                            | 2.49%                            | 258 | 2004/4/14 | 4.81%                            | 2.41%                            | 2.40%                            | 350 | 2004/7/15 | 4.98%                            | 3.04%                            | 1.94%                            |   |
| 75 | 2003/10/14 | 4.73%                            | 2.00%                            | 2.73%                            | 167 | 2004/1/14  | 4.36%                            | 1.94%                            | 2.42%                            | 259 | 2004/4/15 | 4.80%                            | 2.40%                            | 2.40%                            | 351 | 2004/7/16 | 4.86%                            | 2.94%                            | 1.92%                            |   |
| 76 | 2003/10/15 | 4.87%                            | 2.13%                            | 2.74%                            | 168 | 2004/1/15  | 4.37%                            | 2.01%                            | 2.36%                            | 260 | 2004/4/16 | 4.79%                            | 2.34%                            | 2.45%                            | 352 | 2004/7/17 | 4.86%                            | 2.94%                            | 1.92%                            |   |
| 77 | 2003/10/16 | 4.89%                            | 2.22%                            | 2.67%                            | 169 | 2004/1/16  | 4.38%                            | 1.99%                            | 2.39%                            | 261 | 2004/4/17 | 4.79%                            | 2.34%                            | 2.45%                            | 353 | 2004/7/18 | 4.86%                            | 2.94%                            | 1.92%                            |   |
| 78 | 2003/10/17 | 4.85%                            | 2.25%                            | 2.60%                            | 170 | 2004/1/17  | 4.38%                            | 1.99%                            | 2.39%                            | 262 | 2004/4/18 | 4.79%                            | 2.34%                            | 2.45%                            | 354 | 2004/7/19 | 4.84%                            | 2.95%                            | 1.89%                            |   |
| 79 | 2003/10/18 | 4.85%                            | 2.25%                            | 2.60%                            | 171 | 2004/1/18  | 4.38%                            | 1.99%                            | 2.39%                            | 263 | 2004/4/19 | 4.79%                            | 2.37%                            | 2.42%                            | 355 | 2004/7/20 | 4.86%                            | 2.97%                            | 1.89%                            |   |
| 80 | 2003/10/19 | 4.85%                            | 2.25%                            | 2.60%                            | 172 | 2004/1/19  | 4.39%                            | 2.04%                            | 2.35%                            | 264 | 2004/4/20 | 4.83%                            | 2.40%                            | 2.43%                            | 356 | 2004/7/21 | 4.98%                            | 3.13%                            | 1.85%                            |   |
| 81 | 2003/10/20 | 4.80%                            | 2.26%                            | 2.54%                            | 173 | 2004/1/20  | 4.39%                            | 2.01%                            | 2.38%                            | 265 | 2004/4/21 | 4.87%                            | 2.52%                            | 2.35%                            | 357 | 2004/7/22 | 4.94%                            | 3.11%                            | 1.83%                            |   |
| 82 | 2003/10/21 | 4.76%                            | 2.20%                            | 2.56%                            | 174 | 2004/1/21  | 4.41%                            | 2.01%                            | 2.40%                            | 266 | 2004/4/22 | 4.83%                            | 2.48%                            | 2.35%                            | 358 | 2004/7/23 | 4.92%                            | 3.11%                            | 1.81%                            |   |
| 83 | 2003/10/22 | 4.68%                            | 2.17%                            | 2.51%                            | 175 | 2004/1/22  | 4.35%                            | 1.96%                            | 2.39%                            | 267 | 2004/4/23 | 4.87%                            | 2.59%                            | 2.28%                            | 359 | 2004/7/24 | 4.92%                            | 3.11%                            | 1.81%                            |   |
| 84 | 2003/10/23 | 4.76%                            | 2.21%                            | 2.55%                            | 176 | 2004/1/23  | 4.40%                            | 1.98%                            | 2.42%                            | 268 | 2004/4/24 | 4.87%                            | 2.59%                            | 2.28%                            | 360 | 2004/7/25 | 4.92%                            | 3.11%                            | 1.81%                            |   |
| 85 | 2003/10/24 | 4.65%                            | 2.12%                            | 2.53%                            | 177 | 2004/1/24  | 4.40%                            | 1.98%                            | 2.42%                            | 269 | 2004/4/25 | 4.87%                            | 2.59%                            | 2.28%                            | 361 | 2004/7/26 | 4.96%                            | 3.15%                            | 1.81%                            |   |
| 86 | 2003/10/25 | 4.65%                            | 2.12%                            | 2.53%                            | 178 | 2004/1/25  | 4.40%                            | 1.98%                            | 2.42%                            | 270 | 2004/4/26 | 4.90%                            | 2.60%                            | 2.30%                            | 362 | 2004/7/27 | 5.05%                            | 3.21%                            | 1.84%                            |   |
| 87 | 2003/10/26 | 4.65%                            | 2.12%                            | 2.53%                            | 179 | 2004/1/26  | 4.48%                            | 2.04%                            | 2.44%                            | 271 | 2004/4/27 | 4.88%                            | 2.58%                            | 2.30%                            | 363 | 2004/7/28 | 5.09%                            | 3.20%                            | 1.89%                            |   |
| 88 | 2003/10/27 | 4.65%                            | 2.14%                            | 2.51%                            | 180 | 2004/1/27  | 4.48%                            | 2.02%                            | 2.46%                            | 272 | 2004/4/28 | 4.90%                            | 2.59%                            | 2.31%                            | 364 | 2004/7/29 | 5.09%                            | 3.17%                            | 1.92%                            |   |
| 89 | 2003/10/28 | 4.71%                            | 2.23%                            | 2.48%                            | 181 | 2004/1/28  | 4.42%                            | 1.97%                            | 2.45%                            | 273 | 2004/4/29 | 5.02%                            | 2.69%                            | 2.33%                            | 365 | 2004/7/30 | 4.97%                            | 3.09%                            | 1.88%                            |   |
| 90 | 2003/10/29 | 4.63%                            | 2.08%                            | 2.55%                            | 182 | 2004/1/29  | 4.63%                            | 2.24%                            | 2.39%                            | 274 | 2004/4/30 | 4.98%                            | 2.65%                            | 2.33%                            | 366 | 2004/7/31 | 4.97%                            | 3.09%                            | 1.88%                            |   |
| 91 | 2003/10/30 | 4.79%                            | 2.24%                            | 2.55%                            | 183 | 2004/1/30  | 4.55%                            | 2.18%                            | 2.37%                            | 275 | 2004/5/1  | 4.98%                            | 2.65%                            | 2.33%                            |     |           |                                  |                                  |                                  |   |
| 92 | 2003/10/31 | 4.72%                            | 2.19%                            | 2.53%                            | 184 | 2004/1/31  | 4.55%                            | 2.18%                            | 2.37%                            | 276 | 2004/5/2  | 4.98%                            | 2.65%                            | 2.33%                            |     |           |                                  |                                  |                                  |   |

註：1.該日非 CMS 報價日時，其利率以前一報價日之利率計算。

第 7 期之收益分配率為

$$R_7 = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 7\% + 100\% \times \text{Portfolio}_7 \right) \times \frac{g_7}{G_7}, 1\% \right], 10\% \right\} = \text{Min} \left\{ \text{Max} \left[ \left( 7\% + 100\% \times 1.82\% \right) \times \frac{0}{366}, 1\% \right], 10\% \right\}$$

$= \text{Min} \{ \text{Max} ( 0\%, 1\% ), 10\% \} = 1\%$   
收益分配 = 10,000 美元  $\times$  1% = 100 美元

「結構型債券到期金」及「額外收益分配金額」計算步驟如下：

「結構型債券到期金」 = 「結構型債券淨投資金額」 = 10,000 美元

另加發額外收益分配率 8%，即加發額外收益分配金額 = 10,000 美元  $\times$  8% = 800 美元。

『第六種計算公式』

「結構型債券到期金」=「結構型債券淨投資金額」

每一期期末依配息公式分配收益並依條款第十條之約定方式分配

一、配息公式：

第  $h$  期之收益分配 = 「結構型債券淨投資金額」× 第  $h$  期之收益分配率

其中

1. 第  $h$  期之收益分配率 ( $R_h$ ) 之計算公式如下：

$$R_h = \text{Min}[\text{Max}(D_h, E_h + F_h \times \text{Portfolio}_h), \text{Cap}_h]$$

2. 額外收益分配率：於「結構型債券到期日」除給付「結構型債券到期金」及當期收益分配率  $R_T$  外，另加發額外收益分配率  $ED_T$ 。

其中：

$D_h, E_h, F_h, \text{Cap}_h$ ：此四組參數為計算配息之因子，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$T$ ：「結構型債券投資期間」總期數， $T = \sum_{i=1}^H M_i$ 。

$H$ ：結構型債券之投資期間（年數）。

$M_i$ ：第  $i$  年度中之期數， $M_i = 12 / t_{mi}$ 。

$t_{mi}$ ：第  $i$  年度中每一期期間之月數（於每次銷售結構型債券時決定，可能為 1 個月、2 個月、3 個月、6 個月或 12 個月）。

第  $h$  期：係指自「結構型債券發行日」起以每  $t_{mi}$  個月為一期之週期；例如，假設每年以 12 個月為一期 ( $t_{mi} = 12, M_i = 1$ )，而 2007/7/3 為「結構型債券發行日」，則第一期之期間為 2007/7/3 至 2008/7/2，第二期之期間為 2008/7/3 至 2009/7/2，以此類推；但每一期之期初及期末需為結構型債券評價日，若非結構型債券評價日時則需遞延至次一結構型債券評價日。

結構型債券評價日：係指該結構型債券所連結之標的所屬報價市場共同之評價日。

$ED_T$ ：額外收益分配率，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

而第  $h$  期之投資績效 ( $\text{Portfolio}_h$ ) 計算公式如下：

$$\text{Portfolio}_h = \text{Min} \left\{ \text{abs} \left( \frac{\text{Underlying}_1^h}{\text{Underlying}_1^{h-1}} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{\text{Underlying}_2^h}{\text{Underlying}_2^{h-1}} - 1 \right), \dots, \text{abs} \left( \frac{\text{Underlying}_N^h}{\text{Underlying}_N^{h-1}} - 1 \right) \right\}$$

其中

$N$ ：連結之標的個數。

$\text{abs}(x)$ ：指  $x$  之絕對值。

$\text{Underlying}_n^0$ ：第  $n$  個標的於「結構型債券發行日」之收盤值。

$\text{Underlying}_n^h$ ：第  $n$  個標的於第  $h$  期期末前  $dh$  個結構型債券評價日之收盤值。

$dh$ ：此參數為固定數值，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

二、範例說明

（本範例說明僅為使要保人更加了解「結構型債券到期金」及配息之計算方式，其引用數字僅做參考，不代表未來實際情況。）

【假設】

1. 1996 年 7 月 31 日為投入 6 年期 ( $H=6$ ) 結構型債券之發行日，「結構型債券淨投資金額」為 10,000 美元；

2.自「結構型債券發行日」起每12個月為一週期 ( $t_{mi}=12$ ,  $M_i=12/t_{mi}=12/12=1$ ,  $T=\sum_{i=1}^H M_i = \sum_{i=1}^6 1=6$ );

3.連結之標的有5支股票 ( $N=5$ );

4. $D_h=5\%$ ,  $E_h=4\%$ ,  $F_h=5\%$ ,  $Cap_h=20\%$ ,  $dh=5$ ;

5.額外收益分配率:於「結構型債券到期日」加發8% (即  $ED_T=8\%$ )。

6.該5支股票之股價變化如下表,每期之投資績效經計算如下:

| 期數<br>$h$       | 期末日期      | 期末前5個<br>評價日日期 | AXP US | DOW US | GE US | JNJ US | KO US | 投資績效<br>$Portfolio_h$ |
|-----------------|-----------|----------------|--------|--------|-------|--------|-------|-----------------------|
| 「結構型債券發行日」收盤價格  |           |                |        |        |       |        |       |                       |
| 0               | 1996/7/31 |                | 14.58  | 24.75  | 13.71 | 23.88  | 46.88 |                       |
| 每期期末前5個評價日之收盤價格 |           |                |        |        |       |        |       |                       |
| 1               | 1997/7/31 | 1997/7/24      | 26.54  | 30.10  | 23.96 | 30.94  | 70.19 | 21.62%                |
| 2               | 1998/7/31 | 1998/7/24      | 35.69  | 31.06  | 30.56 | 38.28  | 83.44 | 3.19%                 |
| 3               | 1999/8/1  | 1999/7/26      | 45.50  | 40.33  | 38.00 | 48.63  | 63.06 | 24.35%                |
| 4               | 2000/7/31 | 2000/7/24      | 57.06  | 29.53  | 54.00 | 47.23  | 59.25 | 2.88%                 |
| 5               | 2001/7/31 | 2001/7/24      | 37.80  | 33.88  | 44.00 | 52.71  | 44.20 | 11.60%                |
| 6               | 2002/7/31 | 2002/7/24      | 30.43  | 27.45  | 26.53 | 47.70  | 46.85 | 6.00%                 |

計算說明:

第1期,  $h=1$ ; 第1期投資績效

$$\begin{aligned}
 Portfolio_1 &= \text{Min} \left\{ \text{abs} \left( \frac{26.54}{14.58} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{30.10}{24.75} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{23.96}{13.71} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{30.94}{23.88} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{70.19}{46.88} - 1 \right) \right\} \\
 &= \text{Min} \{ \text{abs}(82.03\%), \text{abs}(21.62\%), \text{abs}(74.76\%), \text{abs}(29.56\%), \text{abs}(49.72\%) \} \\
 &= \text{Min} \{ 82.03\%, 21.62\%, 74.76\%, 29.56\%, 49.72\% \} = 21.62\%
 \end{aligned}$$

第2期,  $h=2$ ; 第2期投資績效

$$\begin{aligned}
 Portfolio_2 &= \text{Min} \left\{ \text{abs} \left( \frac{35.69}{26.54} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{31.06}{30.10} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{30.56}{23.96} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{38.28}{30.94} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{83.44}{70.19} - 1 \right) \right\} \\
 &= \text{Min} \{ \text{abs}(34.48\%), \text{abs}(3.19\%), \text{abs}(27.55\%), \text{abs}(23.72\%), \text{abs}(18.88\%) \} \\
 &= \text{Min} \{ 34.48\%, 3.19\%, 27.55\%, 23.72\%, 18.88\% \} = 3.19\%
 \end{aligned}$$

...

第6期,  $h=6$ ; 第6期投資績效

$$\begin{aligned}
 Portfolio_6 &= \text{Min} \left\{ \text{abs} \left( \frac{30.43}{37.80} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{27.45}{33.88} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{26.53}{44.00} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{47.70}{52.71} - 1 \right), \text{abs} \left( \frac{46.85}{44.20} - 1 \right) \right\} \\
 &= \text{Min} \{ \text{abs}(-19.50\%), \text{abs}(-18.98\%), \text{abs}(-39.70\%), \text{abs}(-9.50\%), \text{abs}(6.00\%) \} \\
 &= \text{Min} \{ 19.50\%, 18.98\%, 39.70\%, 9.50\%, 6.00\% \} = 6.00\%
 \end{aligned}$$

【說明】各期收益分配及「結構型債券到期金」計算步驟如下:

● 第1期,  $h=1$

故第1期收益分配率為

$$\begin{aligned}
 R_1 &= \text{Min}[\text{Max}(5\%, 4\%+5\% \times Portfolio_1), 20\%] = \text{Min}[\text{Max}(5\%, 5.08\%), 20\%] = 5.08\% \\
 \text{收益分配} &= 10000 \text{ 美元} \times 5.08\% = 508 \text{ 美元}
 \end{aligned}$$

● 第2期,  $h=2$

故第2期收益分配率為

$$\begin{aligned}
 R_2 &= \text{Min}[\text{Max}(5\%, 4\%+5\% \times Portfolio_2), 20\%] = \text{Min}[\text{Max}(5\%, 4.16\%), 20\%] = 5\% \\
 \text{收益分配} &= 10000 \text{ 美元} \times 5\% = 500 \text{ 美元}
 \end{aligned}$$

● 第3期,  $h=3$

故第3期收益分配率為

$$R_3 = \text{Min}[\text{Max}(5\%, 4\% + 5\% \times \text{Portfolio}_3), 20\%] = \text{Min}[\text{Max}(5\%, 5.22\%), 20\%] = 5.22\%$$

收益分配 = 10000 美元  $\times$  5.22% = 522 美元

● 第 4 期， $h=4$

故第 4 期收益分配率為

$$R_4 = \text{Min}[\text{Max}(5\%, 4\% + 5\% \times \text{Portfolio}_4), 20\%] = \text{Min}[\text{Max}(5\%, 4.14\%), 20\%] = 5\%$$

$$\text{收益分配} = 10000 \text{ 美元} \times 5\% = 500 \text{ 美元}$$

● 第 5 期， $h=5$

故第 5 期收益分配率為

$$R_5 = \text{Min}[\text{Max}(5\%, 4\% + 5\% \times \text{Portfolio}_5), 20\%] = \text{Min}[\text{Max}(5\%, 4.58\%), 20\%] = 5\%$$

$$\text{收益分配} = 10000 \text{ 美元} \times 5\% = 500 \text{ 美元}$$

● 第 6 期， $h=6$

故第 6 期收益分配率為

$$R_6 = \text{Min}[\text{Max}(5\%, 4\% + 5\% \times \text{Portfolio}_6), 20\%] = \text{Min}[\text{Max}(5\%, 4.3\%), 20\%] = 5\%$$

$$\text{收益分配} = 10000 \text{ 美元} \times 5\% = 500 \text{ 美元}$$

「結構型債券到期金」及「額外收益分配金額」計算步驟如下：

「結構型債券到期金」 = 「結構型債券淨投資金額」 = 10,000 美元

另加發額外收益分配率 8%，即加發額外收益分配金額 = 10,000 美元  $\times$  8% = 800 美元。

『第七種計算公式』

「結構型債券到期金」 = 「結構型債券淨投資金額」 × [ 1 + Max ( 投資組合成長率 × 參與率, 最低保證投資報酬率 ) ]

其中：

一、「參與率」及「最低保證投資報酬率」隨結構型債券之不同而不同，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

二、投資組合成長率公式：

$$\text{投資組合成長率} = \sum_{h=1}^T w_h \times \text{Portfolio}_h$$

其中：

第  $h$  期之投資績效 (  $\text{Portfolio}_h$  ) 計算公式如下：

$$\text{Portfolio}_h = \text{Max} \left\{ F, \sum_{n=1}^N W_n^h \times \left( \frac{\text{Underlying}_n^h - \text{Underlying}_n^0}{\text{Underlying}_n^0} \right) \right\}$$

$T$ ：「結構型債券投資期間」總期數， $T = \sum_{i=1}^H M_i$ 。

$H$ ：結構型債券之投資期間（年數）。

$M_i$ ：第  $i$  年度中之期數， $M_i = 12 / t_{mi}$ 。

$t_{mi}$ ：第  $i$  年度中每一期期間之月數（於每次銷售結構型債券時決定，可能為 1 個月、2 個月、3 個月、6 個月或 12 個月）。

第  $h$  期：係指自「結構型債券發行日」起以每  $t_{mi}$  個月為一期之週期；例如，假設每年以 12 個月為一期 ( $t_{mi} = 12, M_i = 1$ )，而 2007/12/11 為「結構型債券發行日」，則第 1 期之期間為 2007/12/11 至 2008/12/10，第 2 期之期間為 2008/12/11 至 2009/12/10，第 3 期之期間為 2009/12/11 至 2010/12/10，以此類推。但每一期之期初及期末需為結構型債券評價日，若非結構型債券評價日時則需遞延至次一結構型債券評價日。

結構型債券評價日：係指該結構型債券所連結之標的所屬報價市場共同之營業日。

$F$ ：此參數為計算配息之因子，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$\text{Portfolio}_h$ ：第  $h$  期之投資績效。

$N$ ：連結之標的個數。

$w_h$ ：第  $h$  期投資績效所佔之權重， $\sum_{n=1}^T w_n = 1$ 。

$W_n^h$ ：第  $n$  個連結標的於第  $h$  期所佔之權重， $\sum_{n=1}^N W_n^h = 1$ 。

$\text{Underlying}_n^0$ ：第  $n$  個連結標的於「結構型債券發行日」之收盤值。

$\text{Underlying}_n^h$ ：第  $n$  個連結標的於第  $h$  期期末前  $dh$  個結構型債券評價日之收盤值。

$dh$ ：此參數為固定數值，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

三、範例說明

（本範例說明僅為使要保人更加了解「結構型債券到期金」之計算方式，其引用數字僅做參考，不代表未來實際情況。）

【假設】

1. 1998 年 6 月 30 日為投入 6 年期 ( $H = 6$ ) 結構型債券之發行日，「結構型債券淨投資金額」為 10,000 美元；

2. 自「結構型債券發行日」起每 12 個月為一週期 ( $t_{mi} = 12, M_i = 12 / t_{mi} = 12 / 12 = 1, T = \sum_{i=1}^H M_i = \sum_{i=1}^6 1 = 6$ )；

3. 連結之標的為 S&P500 指數及 DJ Eurostoxx 50 指數，每期之投資績效權重為 2 支指數之績效平均 ( $W_1^h = W_2^h = 1/2$ )；

4. 各期之投資績效權重皆相同 ( $w_1 = w_2 = \dots = w_6 = 1/6$ )；

5. 參與率為 65%，最低保證投資報酬率為 23%， $dh = 0, F = 10\%$ ；

6. 連結標的之各期期初及期末收盤值如下：

| 期數 $h$        | 期末日期      | S&P500 指數 | DJ Eurostoxx 50 指數 | $Portfolio_h$ |
|---------------|-----------|-----------|--------------------|---------------|
| 「結構型債券發行日」收盤值 |           |           |                    |               |
| 0             | 2000/6/30 | 1454.60   | 5145.35            | —             |
| 每期期末收盤值       |           |           |                    |               |
| 1             | 2001/7/2  | 1236.72   | 4304.44            | 10.00%        |
| 2             | 2002/7/1  | 968.65    | 3131.39            | 10.00%        |
| 3             | 2003/6/30 | 974.50    | 2419.51            | 10.00%        |
| 4             | 2004/6/30 | 1140.84   | 2811.08            | 10.00%        |
| 5             | 2005/6/30 | 1191.33   | 3181.54            | 10.00%        |
| 6             | 2006/6/30 | 1270.20   | 3648.92            | 10.00%        |

各期投資績效計算步驟如下：

● 第 1 期， $h = 1$

$$Portfolio_1 = \text{Max} \left\{ 10\%, \frac{1}{2} \times \left[ \left( \frac{1236.72 - 1454.60}{1454.60} + \frac{4304.44 - 5145.35}{5145.35} \right) \right] \right\} = \text{Max} \{ 10\%, (-15.66\%) \} = 10.00\%$$

● 第 2 期， $h = 2$

$$Portfolio_2 = \text{Max} \left\{ 10\%, \frac{1}{2} \times \left[ \left( \frac{968.65 - 1454.60}{1454.60} + \frac{3131.39 - 5145.35}{5145.35} \right) \right] \right\} = \text{Max} \{ 10\%, (-36.28\%) \} = 10.00\%$$

.....

● 第 6 期， $h = 6$

$$Portfolio_6 = \text{Max} \left\{ 10\%, \frac{1}{2} \times \left[ \left( \frac{1270.20 - 1454.60}{1454.60} + \frac{3648.92 - 5145.35}{5145.35} \right) \right] \right\} = \text{Max} \{ 10\%, (-20.88\%) \} = 10.00\%$$

「結構型債券到期金」計算步驟如下：

$$\begin{aligned} \text{投資組合成長率} &= \sum_{h=1}^6 w_h \times Portfolio_h = (10.00\% + 10.00\% + 10.00\% + 10.00\% + 10.00\% + 10.00\%) / 6 \\ &= 10.00\% \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{「結構型債券到期金」} &= \text{「結構型債券淨投資金額」} \times [1 + \text{Max}(\text{投資組合成長率} \times \text{參與率}, \text{最低保證投資報酬率})] \\ &= 10,000 \text{ 美元} \times [1 + \text{Max}(10.00\% \times 65\%, 23\%)] \\ &= 10,000 \text{ 美元} \times [1 + \text{Max}(6.50\%, 23\%)] = 12,300 \text{ 美元} \end{aligned}$$

『第八種計算公式』

「結構型債券到期金」 = 「結構型債券淨投資金額」 × [1 + Max (投資組合成長率 × 參與率, 最低保證投資報酬率)]

其中：

一、「參與率」及「最低保證投資報酬率」隨結構型債券之不同而不同，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

二、投資組合成長率計算公式如下：

$$\text{投資組合成長率} = \sum_{h=1}^T w_h \times \text{Return}_h$$

其中  $\text{Return}_h$  = 於第  $h$  期期間，每一結構型債券評價日所計算之  $\text{Basket}_d^h$  數值中之最大值，減去

$$= \text{Max}(\text{Basket}_1^h, \text{Basket}_2^h, \text{Basket}_3^h, \dots, \text{Basket}_{G_h}^h) - 1$$

$$\text{Basket}_d^h = \sum_{n=1}^N W_n^h \times \frac{\text{Underlying}_n^{h,d}}{\text{Underlying}_n^0}$$

$$T : \text{「結構型債券投資期間」總期數, } T = \sum_{i=1}^H M_i。$$

$H$  : 結構型債券之投資期間 (年數)。

$M_i$  : 第  $i$  年度中之期數,  $M_i = 12 / t_{mi}$ 。

$t_{mi}$  : 第  $i$  年度中每一期期間之月數 (於每次銷售結構型債券時決定, 可能為 1 個月、2 個月、3 個月、6 個月或 12 個月)。

第  $h$  期 : 係指自「結構型債券發行日」起以每  $t_{mi}$  個月為一期之週期；例如，假設每 3 個月為一期 ( $t_{mi}=3, M_i=4$ )，而 2007/1/15 為「結構型債券發行日」，則第一期之期間為 2007/1/15 至 2007/4/14，第二期之期間為 2007/4/15 至 2007/7/14，以此類推；但每一期之期初及期末需為結構型債券評價日，若非結構型債券評價日時則需遞延至次一結構型債券評價日。

結構型債券評價日 : 係指該結構型債券所連結之標的所屬報價市場共同之營業日。

$w_h$  : 第  $h$  期投資績效所佔之權重。

$W_n^h$  : 第  $n$  個標的於第  $h$  期所佔之權重,  $\sum_{n=1}^N W_n^h = 1$ 。

$\text{Return}_h$  : 第  $h$  期之投資績效。

$G_h$  : 第  $h$  期期間中，所有結構型債券評價日之總日數。

$N$  : 連結之標的個數。

$\text{Underlying}_n^0$  : 第  $n$  個標的於「結構型債券發行日」之收盤值。

$\text{Underlying}_n^{h,d}$  : 第  $n$  個標的於第  $h$  期第  $d$  個結構型債券評價日之收盤值。

三、範例說明

(本範例說明僅為使要保人更加了解「結構型債券到期金」之計算方式，其引用數字僅做參考，不代表未來實際情況。)

【假設】

1. 1998 年 6 月 30 日為投入 6 年期 ( $H=6$ ) 結構型債券之發行日，「結構型債券淨投資金額」為 10,000 歐元；

2. 自「結構型債券發行日」起每 3 個月為一週期 ( $t_{mi} = 3, M_i = 12 / t_{mi} = 12 / 3 = 4, T = \sum_{i=1}^H M_i = \sum_{i=1}^6 4 = 24$ )；

3. 連結之標的為 3 組指數 ( $N=3$ )，每期之投資績效權重為 3 支指數之績效平均 ( $W_1^h = W_2^h = W_3^h = 1/3$ )；

4. 各期之投資績效權重皆相同 ( $w_1 = w_2 = \dots = w_{24} = 1/24$ )；

5. 參與率為 65%，6 年期滿最低保證投資報酬率為 23%；

6. 連結指數於各期之評價日收盤指數如下：

第一期：

| 日期             | S&P500 指數 | DJ EUROSTOXX50 指數 | TOPIX 指數 | Basket  |
|----------------|-----------|-------------------|----------|---------|
| 「結構型債券發行日」收盤指數 |           |                   |          |         |
| 1998/6/30      | 1133.84   | 3406.82           | 1230.38  |         |
| 第一期各評價日收盤指數    |           |                   |          |         |
| 1998/7/1       | 1148.56   | 3464.96           | 1270.75  | 102.10% |
| 1998/7/2       | 1146.42   | 3471.65           | 1270.46  | 102.09% |
| 1998/7/6       | 1157.31   | 3518.79           | 1258.45  | 102.55% |
| 1998/7/7       | 1154.66   | 3530.93           | 1264.81  | 102.76% |
| 1998/7/8       | 1166.37   | 3553.07           | 1268.4   | 103.42% |
| 1998/7/9       | 1158.56   | 3542.2            | 1262.28  | 102.92% |
| 1998/7/10      | 1164.33   | 3532.65           | 1241.5   | 102.43% |
| 1998/7/13      | 1165.19   | 3551.74           | 1256.44  | 103.05% |
| 1998/7/14      | 1177.58   | 3576.68           | 1266.65  | 103.93% |
| 1998/7/15      | 1174.81   | 3602.83           | 1275.31  | 104.34% |
| 1998/7/16      | 1183.99   | 3613.4            | 1280.73  | 104.86% |
| 1998/7/17      | 1186.75   | 3658.48           | 1277.95  | 105.31% |
| 1998/7/21      | 1165.07   | 3649.96           | 1277.17  | 104.56% |
| 1998/7/22      | 1164.08   | 3582.12           | 1257.85  | 103.35% |
| 1998/7/23      | 1139.75   | 3582.16           | 1249.87  | 102.42% |
| 1998/7/24      | 1140.8    | 3570.67           | 1258.01  | 102.56% |
| 1998/7/27      | 1147.27   | 3512.62           | 1233.98  | 101.53% |
| 1998/7/28      | 1130.24   | 3499.87           | 1242.22  | 101.13% |
| 1998/7/29      | 1125.21   | 3494.53           | 1240.7   | 100.88% |
| 1998/7/30      | 1142.95   | 3529.5            | 1248.19  | 101.95% |
| 1998/7/31      | 1120.67   | 3480.63           | 1262.04  | 101.19% |
| 1998/8/3       | 1112.44   | 3422.75           | 1245.24  | 99.93%  |
| 1998/8/4       | 1072.12   | 3412.66           | 1234.61  | 98.36%  |
| 1998/8/5       | 1081.43   | 3344.15           | 1235.78  | 97.99%  |
| 1998/8/6       | 1089.63   | 3290.5            | 1227.09  | 97.47%  |
| 1998/8/7       | 1089.45   | 3348.61           | 1225.3   | 97.99%  |
| 1998/8/10      | 1083.14   | 3282.7            | 1207.09  | 96.66%  |
| 1998/8/11      | 1068.98   | 3187.44           | 1186.88  | 94.77%  |
| 1998/8/12      | 1084.22   | 3248.14           | 1180     | 95.62%  |
| 1998/8/13      | 1074.91   | 3240.83           | 1181.71  | 95.32%  |
| 1998/8/14      | 1062.75   | 3284.47           | 1168.8   | 95.04%  |
| 1998/8/17      | 1083.67   | 3277.21           | 1152.03  | 95.13%  |
| 1998/8/18      | 1101.2    | 3389.88           | 1166.72  | 97.15%  |
| 1998/8/19      | 1098.06   | 3400.07           | 1183.71  | 97.62%  |
| 1998/8/20      | 1091.6    | 3349.23           | 1181.67  | 96.88%  |
| 1998/8/21      | 1081.18   | 3209.05           | 1176.51  | 95.06%  |
| 1998/8/24      | 1088.14   | 3202.96           | 1158.3   | 94.71%  |
| 1998/8/25      | 1092.86   | 3282.91           | 1162.58  | 95.75%  |
| 1998/8/26      | 1084.19   | 3186.77           | 1147.21  | 94.13%  |
| 1998/8/27      | 1042.59   | 3063.83           | 1116.97  | 90.89%  |
| 1998/8/28      | 1027.14   | 3009.74           | 1086.99  | 89.09%  |
| 1998/8/31      | 957.28    | 2978.12           | 1106.49  | 87.26%  |
| 1998/9/1       | 994.24    | 2950.01           | 1110.15  | 88.17%  |
| 1998/9/2       | 990.47    | 3035.73           | 1118.76  | 89.13%  |
| 1998/9/3       | 982.26    | 2971.38           | 1113.77  | 88.12%  |
| 1998/9/4       | 973.89    | 3003.66           | 1094.47  | 87.67%  |
| 1998/9/8       | 1023.46   | 3105.31           | 1131.01  | 91.11%  |
| 1998/9/9       | 1006.2    | 3051.49           | 1116.01  | 89.67%  |
| 1998/9/10      | 980.19    | 2903.71           | 1109.91  | 87.30%  |
| 1998/9/11      | 1009.06   | 2890.98           | 1071.48  | 86.98%  |
| 1998/9/14      | 1029.72   | 2968.55           | 1084.16  | 88.69%  |
| 1998/9/16      | 1045.48   | 2971.83           | 1087.5   | 89.28%  |
| 1998/9/17      | 1018.87   | 2826.22           | 1069.06  | 86.57%  |
| 1998/9/18      | 1020.09   | 2781.69           | 1073.22  | 86.28%  |
| 1998/9/21      | 1023.89   | 2658.27           | 1047.79  | 84.50%  |
| 1998/9/22      | 1029.63   | 2726.32           | 1050.17  | 85.40%  |
| 1998/9/24      | 1042.72   | 2789.07           | 1078.01  | 87.15%  |
| 1998/9/25      | 1044.75   | 2743.04           | 1049.93  | 86.00%  |
| 1998/9/28      | 1048.69   | 2785.63           | 1063.52  | 86.90%  |
| 1998/9/29      | 1049.02   | 2760.26           | 1062.9   | 86.64%  |
| 1998/9/30      | 1017.01   | 2670.97           | 1043.57  | 84.30%  |
| Basket 最大值     |           |                   |          | 105.31% |

計算第一期每個評價日之 Basket

於 1998/7/1 時，Basket<sub>1</sub><sup>1</sup> 為

$$\frac{1}{3} \times \left( \frac{1148.56}{1133.84} + \frac{3464.96}{3406.82} + \frac{1270.75}{1230.38} \right) = 102.10\%$$

於 1998/7/2 時，Basket<sub>2</sub><sup>1</sup> 為

$$\frac{1}{3} \times \left( \frac{1146.42}{1133.84} + \frac{3471.65}{3406.82} + \frac{1270.46}{1230.38} \right) = 102.09\%$$

...  
...  
...

於 1998/9/30 時，Basket<sub>GI</sub><sup>1</sup> 為

$$\frac{1}{3} \times \left( \frac{1017.01}{1133.84} + \frac{2670.97}{3406.82} + \frac{1043.57}{1230.38} \right) = 84.30\%$$

則

第一期之 Return<sub>1</sub> 為

$$= \text{Max}(102.10\%, 102.09\%, \dots, 84.30\%) - 1 = 105.31\% - 1 = 5.31\%$$

第二期：

| 日期             | S&P500 指數 | DJ EUROSTOXX50 指數 | TOPIX 指數 | Basket |
|----------------|-----------|-------------------|----------|--------|
| 「結構型債券發行日」收盤指數 |           |                   |          |        |
| 1998/6/30      | 1133.84   | 3406.82           | 1230.38  |        |
| 第二期各評價日收盤指數    |           |                   |          |        |
| 1998/10/1      | 986.39    | 2533.07           | 1015.72  | 81.30% |
| 1998/10/2      | 1002.6    | 2488.59           | 1014.02  | 81.30% |
| 1998/10/5      | 988.56    | 2445.89           | 996.69   | 80.00% |
| 1998/10/6      | 984.59    | 2586.69           | 996.95   | 81.26% |
| 1998/10/7      | 970.68    | 2541.08           | 1046.98  | 81.76% |
| 1998/10/8      | 959.44    | 2419.23           | 1001.5   | 79.01% |
| 1998/10/9      | 984.39    | 2469.87           | 982.5    | 79.72% |
| 1998/10/12     | 997.71    | 2628.44           | 1023.34  | 82.77% |
| 1998/10/13     | 994.8     | 2674.13           | 998.98   | 82.47% |
| 1998/10/14     | 1005.53   | 2742.95           | 984.18   | 83.06% |
| 1998/10/15     | 1047.49   | 2741.34           | 980.11   | 84.17% |
| 1998/10/16     | 1056.42   | 2780.89           | 1006.68  | 85.54% |
| 1998/10/19     | 1062.39   | 2779.79           | 1022.92  | 86.14% |
| 1998/10/20     | 1063.93   | 2863.89           | 1043.02  | 87.56% |
| 1998/10/21     | 1069.92   | 2818.18           | 1071.83  | 88.07% |
| 1998/10/22     | 1078.48   | 2797.33           | 1074.29  | 88.18% |
| 1998/10/23     | 1070.67   | 2806.22           | 1068.15  | 87.87% |
| 1998/10/26     | 1072.32   | 2829.55           | 1048.74  | 87.62% |
| 1998/10/27     | 1065.34   | 2910.1            | 1042.98  | 88.05% |
| 1998/10/28     | 1068.09   | 2845.3            | 1028.61  | 87.11% |
| 1998/10/29     | 1085.93   | 2832.82           | 1037.1   | 87.74% |
| 1998/10/30     | 1098.67   | 2887.11           | 1035.6   | 88.60% |
| 1998/11/2      | 1111.6    | 2952.04           | 1065.84  | 90.44% |
| 1998/11/4      | 1118.67   | 3030.34           | 1107.36  | 92.54% |
| 1998/11/5      | 1133.85   | 2975.7            | 1104.57  | 92.37% |
| 1998/11/6      | 1141.01   | 2972.25           | 1089.47  | 92.14% |
| 1998/11/9      | 1130.2    | 2957.79           | 1084.16  | 91.54% |
| 1998/11/10     | 1128.26   | 2918.94           | 1078.32  | 90.94% |
| 1998/11/11     | 1120.97   | 2935.14           | 1098.12  | 91.42% |
| 1998/11/12     | 1117.69   | 2929.19           | 1082.93  | 90.86% |
| 1998/11/13     | 1125.72   | 2924.97           | 1093.52  | 91.34% |
| 1998/11/16     | 1135.86   | 3000.97           | 1105.5   | 92.71% |
| 1998/11/17     | 1139.32   | 2982.07           | 1107.65  | 92.68% |
| 1998/11/18     | 1144.48   | 2974.98           | 1113.42  | 92.92% |
| 1998/11/19     | 1152.61   | 3049.68           | 1104     | 93.63% |
| 1998/11/20     | 1163.55   | 3133.49           | 1130.74  | 95.50% |
| 1998/11/24     | 1182.99   | 3163.88           | 1155.61  | 97.04% |
| 1998/11/25     | 1186.87   | 3167.24           | 1153.68  | 97.14% |
| 1998/11/27     | 1192.29   | 3261.19           | 1158.35  | 98.34% |
| 1998/11/30     | 1163.63   | 3179.09           | 1143.5   | 96.29% |
| 1998/12/1      | 1175.28   | 3056.11           | 1142.26  | 95.40% |
| 1998/12/2      | 1171.25   | 3017.89           | 1147.15  | 95.04% |
| 1998/12/3      | 1150.14   | 3064.55           | 1128.89  | 94.38% |
| 1998/12/4      | 1176.74   | 3079.64           | 1120.72  | 95.09% |
| 1998/12/7      | 1187.7    | 3095.55           | 1125     | 95.68% |
| 1998/12/8      | 1181.38   | 3102.99           | 1131.99  | 95.76% |
| 1998/12/9      | 1183.49   | 3111.96           | 1140.74  | 96.15% |
| 1998/12/10     | 1165.02   | 3106.59           | 1139.78  | 95.52% |
| 1998/12/11     | 1166.46   | 3048.92           | 1118.16  | 94.42% |
| 1998/12/14     | 1141.2    | 3045.14           | 1100.31  | 93.15% |
| 1998/12/15     | 1162.83   | 3069.72           | 1089.27  | 93.73% |
| 1998/12/16     | 1161.94   | 3114.53           | 1093.39  | 94.25% |
| 1998/12/17     | 1179.98   | 3148.97           | 1092.26  | 95.09% |
| 1998/12/18     | 1188.03   | 3123.38           | 1101.7   | 95.33% |
| 1998/12/21     | 1202.84   | 3225.6            | 1099.12  | 96.70% |
| 1998/12/22     | 1203.57   | 3248.07           | 1082.46  | 96.49% |
| 1998/12/28     | 1225.49   | 3331.51           | 1079.89  | 97.88% |
| 1998/12/29     | 1241.81   | 3354.71           | 1088.83  | 98.83% |
| 1998/12/30     | 1231.93   | 3342.32           | 1086.99  | 98.37% |
| Basket 最大值     |           |                   |          | 98.83% |

• • •  
• • •  
• • •

計算第二期每個評價日之 Basket

於 1998/10/1 時，Basket<sub>1</sub><sup>2</sup> 為

$$\frac{1}{3} \times \left( \frac{986.39}{1133.84} + \frac{2533.07}{3406.82} + \frac{1015.72}{1230.38} \right) = 81.30\%$$

於 1998/10/2 時，Basket<sub>2</sub><sup>2</sup> 為

$$\frac{1}{3} \times \left( \frac{1002.6}{1133.84} + \frac{2488.59}{3406.82} + \frac{1014.02}{1230.38} \right) = 81.30\%$$

...  
...  
...

於 1998/12/30 時，Basket<sub>32</sub><sup>2</sup> 為

$$\frac{1}{3} \times \left( \frac{1231.93}{1133.84} + \frac{3342.32}{3406.82} + \frac{1086.99}{1230.38} \right) = 98.37\%$$

則  
第二期之 Return<sub>2</sub>  
=Max (81.30%,81.30%,...,98.37%)-1  
=98.83%-1  
=-1.17%

第二十四期（最後一期）：

| 日期             | S&P500 指數 | DJ EUROSTOXX50 指數 | TOPIX 指數 | Basket |
|----------------|-----------|-------------------|----------|--------|
| 「結構型債券發行日」收盤指數 |           |                   |          |        |
| 1998/6/30      | 1133.84   | 3406.82           | 1230.38  |        |
| 第一期各評價日收盤指數    |           |                   |          |        |
| 2004/3/31      | 1126.21   | 2787.49           | 1179.23  | 92.33% |
| 2004/4/1       | 1132.17   | 2819.7            | 1175.01  | 92.71% |
| 2004/4/2       | 1141.81   | 2885.08           | 1184.2   | 93.88% |
| 2004/4/5       | 1150.57   | 2905.88           | 1199.24  | 94.75% |
| 2004/4/6       | 1148.16   | 2865.03           | 1209.44  | 94.55% |
| 2004/4/7       | 1140.53   | 2851.83           | 1204.81  | 94.07% |
| 2004/4/8       | 1139.32   | 2858.92           | 1209.89  | 94.25% |
| 2004/4/13      | 1129.44   | 2889.91           | 1216.6   | 94.44% |
| 2004/4/14      | 1128.17   | 2856.61           | 1217.87  | 94.11% |
| 2004/4/15      | 1128.84   | 2854.53           | 1194.67  | 93.48% |
| 2004/4/16      | 1134.61   | 2866.95           | 1196.18  | 93.81% |
| 2004/4/19      | 1135.82   | 2859.24           | 1182.97  | 93.42% |
| 2004/4/20      | 1118.15   | 2878.8            | 1204.37  | 93.67% |
| 2004/4/21      | 1124.09   | 2855.46           | 1203.59  | 93.59% |
| 2004/4/22      | 1139.93   | 2877.65           | 1205.8   | 94.34% |
| 2004/4/23      | 1140.6    | 2894.18           | 1209.62  | 94.62% |
| 2004/4/26      | 1135.53   | 2886.05           | 1210.96  | 94.43% |
| 2004/4/27      | 1138.11   | 2884.82           | 1204.94  | 94.33% |
| 2004/4/28      | 1122.41   | 2836.67           | 1206.92  | 93.45% |
| 2004/4/30      | 1107.3    | 2787.48           | 1186.31  | 91.97% |
| 2004/5/6       | 1113.99   | 2765.74           | 1165.24  | 91.38% |
| 2004/5/7       | 1098.7    | 2756.85           | 1150.89  | 90.45% |
| 2004/5/10      | 1087.12   | 2684.96           | 1085.54  | 87.64% |
| 2004/5/11      | 1095.45   | 2721.08           | 1088.89  | 88.33% |
| 2004/5/12      | 1097.28   | 2680.1            | 1122.31  | 88.89% |
| 2004/5/13      | 1096.44   | 2712.5            | 1095.93  | 88.46% |
| 2004/5/14      | 1095.7    | 2694.92           | 1091.51  | 88.15% |
| 2004/5/17      | 1084.1    | 2659.85           | 1053.77  | 86.44% |
| 2004/5/18      | 1091.49   | 2675.75           | 1076.21  | 87.43% |
| 2004/5/19      | 1088.68   | 2729.52           | 1106.16  | 88.68% |
| 2004/5/20      | 1089.19   | 2708.55           | 1104.89  | 88.46% |
| 2004/5/21      | 1093.56   | 2697.46           | 1125.21  | 89.03% |
| 2004/5/24      | 1095.41   | 2716.07           | 1130.89  | 89.42% |
| 2004/5/25      | 1113.05   | 2699.36           | 1115.66  | 89.36% |
| 2004/5/26      | 1114.94   | 2729.62           | 1127.24  | 90.02% |
| 2004/5/27      | 1121.28   | 2752.02           | 1126.64  | 90.41% |
| 2004/5/28      | 1120.68   | 2736.83           | 1142.38  | 90.67% |
| 2004/6/1       | 1121.2    | 2713.29           | 1144.27  | 90.51% |
| 2004/6/2       | 1124.99   | 2730.15           | 1136.87  | 90.59% |
| 2004/6/3       | 1116.64   | 2736.72           | 1119.56  | 89.94% |
| 2004/6/4       | 1122.5    | 2767.87           | 1124.97  | 90.56% |
| 2004/6/7       | 1140.42   | 2799.81           | 1151.67  | 92.12% |
| 2004/6/8       | 1142.18   | 2800.36           | 1157.92  | 92.35% |
| 2004/6/9       | 1131.33   | 2787.39           | 1152.77  | 91.76% |
| 2004/6/10      | 1136.47   | 2800.18           | 1162.06  | 92.29% |
| 2004/6/14      | 1125.29   | 2759.27           | 1158.54  | 91.47% |
| 2004/6/15      | 1132.01   | 2785.68           | 1151.3   | 91.73% |
| 2004/6/16      | 1133.56   | 2807.15           | 1167.09  | 92.41% |
| 2004/6/17      | 1132.05   | 2807.16           | 1166.78  | 92.36% |
| 2004/6/18      | 1135.02   | 2822.06           | 1149.88  | 92.13% |
| 2004/6/21      | 1130.3    | 2816.56           | 1165.25  | 92.36% |
| 2004/6/22      | 1134.41   | 2782.43           | 1162.31  | 92.06% |
| 2004/6/23      | 1144.06   | 2793.63           | 1156.16  | 92.29% |
| 2004/6/24      | 1140.65   | 2822.35           | 1168.96  | 92.82% |
| 2004/6/25      | 1134.43   | 2818.86           | 1172.44  | 92.69% |
| 2004/6/28      | 1133.35   | 2840.04           | 1186.6   | 93.25% |
| 2004/6/29      | 1136.2    | 2828.59           | 1187.01  | 93.24% |
| 2004/6/30      | 1140.84   | 2811.08           | 1189.6   | 93.27% |
| Basket 最大值     |           |                   |          | 94.75% |

計算最後一期每個評價日之 Basket

於 2004/3/31 時， $Basket_1^{24}$  為

$$\frac{1}{3} \times \left( \frac{1126.21}{1133.84} + \frac{2787.49}{3406.82} + \frac{1179.23}{1230.38} \right) = 92.33\%$$

於 2004/4/1 時， $Basket_2^{24}$  為

$$\frac{1}{3} \times \left( \frac{1132.17}{1133.84} + \frac{2819.7}{3406.82} + \frac{1175.01}{1230.38} \right) = 92.71\%$$

...  
...  
...

於 2004/6/30 時， $Basket_{G24}^{24}$  為

$$\frac{1}{3} \times \left( \frac{1140.84}{1133.84} + \frac{2811.08}{3406.82} + \frac{1189.6}{1230.38} \right) = 93.27\%$$

則  
第二十四期之  $Return_{24}$   
=  $Max(92.33\%, 92.71\%, \dots, 93.27\%) - 1$   
=  $94.75\% - 1$   
=  $-5.25\%$

統計每期之  $Return_i$  如下表：

| 期數 | $Return_i$ |
|----|------------|
| 1  | 5.31%      |
| 2  | -1.17%     |
| 3  | 8.14%      |
| 4  | 15.95%     |
| 5  | 21.21%     |
| 6  | 37.70%     |
| 7  | 44.29%     |
| 8  | 42.42%     |
| 9  | 39.52%     |
| 10 | 31.96%     |
| 11 | 22.15%     |
| 12 | 20.71%     |
| 13 | 12.85%     |
| 14 | 0.44%      |
| 15 | 1.70%      |
| 16 | -0.72%     |
| 17 | -11.70%    |
| 18 | -22.29%    |
| 19 | -24.63%    |
| 20 | -21.37%    |
| 21 | -14.77%    |
| 22 | -12.19%    |
| 23 | -6.53%     |
| 24 | -5.25%     |

故，

投資組合標的成長率

$$= \frac{1}{24} \times [5.31\% + (-1.17\%) + 8.14\% \dots + (-6.53\%) + (-5.25\%)]$$

$$= 7.66\%$$

以此例計算：

「結構型債券到期金」

$$= 10,000 \text{ 歐元} \times [1 + \text{Max}(7.66\% \times 65\%, 23\%)]$$

$$= 12,300 \text{ 歐元}$$

『第九種計算公式』

「結構型債券到期金」 = 「結構型債券淨投資金額」 × MAX[1 + 最低保證投資報酬率,  $BP_{end}$ ,  $BP_{sup} \times PR_{sup}$ ]

每一期期末依配息公式分配收益並依條款第十條之約定方式分配

一、配息公式：

第  $h$  期之收益分配 = 「結構型債券淨投資金額」 × 第  $h$  期之收益分配率

其中

第  $h$  期之收益分配率 ( $R_h$ ) 之計算公式如下：

$$R_h = \text{Min} \{ \text{Max}[ (PR_h \times BP_h - A_h), \text{Floor}_h ], \text{Cap}_h \}$$

本結構型債券係透過 CPPI (Constant Proportion Portfolio Insurance; 固定比例投資組合保險) 之操作模式, 將購買結構型債券之本金配置於兩種類別之資產組合, 一是風險性資產組合 (即前述標之物之組合), 另一是無風險性資產組合 (以債券市場或貨幣市場之相關資產為主)。若遇風險性資產組合的價格下跌, 則將原配置於風險性資產組合之比例調降, 並增加無風險性資產組合的配置; 反之若風險性資產組合價格上漲, 則加重比例配置於風險性資產組合; 整個計量化調整配置與交易操作, 非由人為決定資產之配置比例, 而利用期初建置 CPPI 參數計量模型定期自動計算風險暴露程度, 依此調整風險性與無風險性資產組合之配置比例, 兼顧獲利與保本以達成最佳獲利之目的。

假設期初風險暴露程度預計為  $K_0$ , 該值最高不超過  $K_{max}$ , 風險暴露程度若超過 100% 時, 將由結構型債券發行機構自行進行槓桿操作融資來達成。發行機構須定期計算風險性資產組合之風險暴露程度  $K_h = (1 - \text{參考水準} \div BP_h) \times \text{槓桿倍數}$ , 並依上述配置比例調整機制, 其中參考水準表示無風險性資產組合價格。

$T$  : 「結構型債券投資期間」總期數,  $T = \sum_{i=1}^H M_i$ 。

$H$  : 結構型債券之投資期間 (年數)。

$M_i$  : 第  $i$  年度中之期數,  $M_i = 12 / t_{mi}$ 。

$t_{mi}$  : 第  $i$  年度中每一期期間之月數 (於每次銷售結構型債券時決定, 可能為 1 個月、2 個月、3 個月、6 個月或 12 個月)。

第  $h$  期 : 指自「結構型債券發行日」起以每  $t_{mi}$  個月為一期之週期; 例如, 假設每年以 12 個月為一期 ( $t_{mi} = 12, M_i = 1$ ), 而 2007/12/11 為「結構型債券發行日」, 則第 1 期之期間為 2007/12/11 至 2008/12/10, 第 2 期之期間為 2008/12/11 至 2009/12/10, 第 3 期之期間為 2009/12/11 至 2010/12/10, 以此類推。但每一期之期初及期末需為結構型債券評價日, 若非結構型債券評價日時則需遞延至次一結構型債券評價日。

$BP_h$  : 本結構型債券於第  $h$  觀察期期末前  $dh$  個評價日之「結構型債券市價相對價格比率」, 而  $BP_0$  為本結構型債券於「結構型債券發行日」之「結構型債券市價相對價格比率」, 本公司屆時將於網站公佈。

$BP_{end}$  : 為本結構型債券於最後一期觀察期期末前  $dh$  個評價日之「結構型債券市價相對價格比率」。

$BP_{sup}$  : 為本結構型債券於「結構型債券發行日」至最後一期觀察期期末前  $dh$  個評價日所有「結構型債券市價相對價格比率」之最大值。

$dh$  : 此參數為固定數值, 於每次銷售結構型債券時決定, 本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$A_h$  : 每期配息門檻報酬率, 於每次銷售結構型債券時決定, 本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$PR_h, \text{Floor}_h, \text{Cap}_h$  : 此三組參數為計算配息之因子, 於每次銷售結構型債券時決定, 本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$PR_{sup}$  : 此參數為計算「結構型債券到期金」之因子, 於每次銷售結構型債券時決定, 本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

$K_{max}$  : 最大風險暴露程度。

$K_0$  : 期初風險暴露程度。

$K_h$  : 第  $h$  期之風險暴露程度。

$K_h = (1 - \text{參考水準} \div BP_h) \times \text{槓桿倍數}$ , 且  $K_h$  不得超過  $K_{max}$ , 若超過則以  $K_{max}$  為其風險暴露程度, 其中參考水準為無風險性資產組合價格。

$K_{max}$ 、 $K_0$ 、無風險性資產組合以及風險性資產組合隨結構型債券之不同而不同, 於每次銷售結構型債券時決定, 本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

二、範例說明

(本範例說明僅為使要保人更加了解「結構型債券到期金」及配息之計算方式，其引用數字僅做參考，不代表未來實際情況。)

【假設】

1. 1998年6月30日為投入6年期( $H=6$ )結構型債券之發行日，「結構型債券淨投資金額」為10,000美元；
2. 連結之風險型資產標的為S&P 500 Index，無風險型資產為美國政府零息公債；
3. 自「結構型債券發行日」起每12個月為一週期( $t_{mi}=12$ ,  $M_i=12/t_{mi}=12/12=1$ ,  $T=\sum_{i=1}^H M_i=6$ )；
4.  $A_h=110\%$ ,  $PR_h=100\%$ ,  $BP_0=1$ ,  $Floor_h=0\%$ ,  $Cap_h=100\%$ ,  $dh=0$ , 最低保證投資報酬率 = 10%,  $PR_{sup}=80\%$ ；
5. 本債券觀察期期末之「結構型債券市價相對價格比率」 $BP_h$ 之資料如下表，且此6年所有「結構型債券市價相對價格比率」之最大值 $BP_{sup}$ 為2001/09/25之1.4020：

| 期數 $h$ | 第 $h$ 觀察期期末日 | 「結構型債券市價相對價格比率」 $BP_h$ |
|--------|--------------|------------------------|
| 0      | 1998/06/30   | 1.0000                 |
| 1      | 1999/06/30   | 1.0930                 |
| 2      | 2000/06/30   | 1.2652                 |
| 3      | 2001/06/29   | 1.3115                 |
| 4      | 2002/06/29   | 1.3030                 |
| 5      | 2003/06/30   | 1.3280                 |
| 6      | 2004/06/29   | 1.3500                 |

【說明】各期收益分配及「結構型債券到期金」計算步驟如下：

各期收益分配計算步驟如下：

- 第1期， $h=1$   
 $R_1 = \text{Min} \{ \text{Max} [ (100\% \times 1.0930 - 110\%), 0\% ], 100\% \} = 0\%$   
 第1期之收益分配 = 10,000 美元  $\times$  0% = 0 美元
- 第2期， $h=2$   
 $R_2 = \text{Min} \{ \text{Max} [ (100\% \times 1.2652 - 110\%), 0\% ], 100\% \} = 16.52\%$   
 第2期之收益分配 = 10,000 美元  $\times$  16.52% = 1,652 美元
- 第3期， $h=3$   
 $R_3 = \text{Min} \{ \text{Max} [ (100\% \times 1.3115 - 110\%), 0\% ], 100\% \} = 21.15\%$   
 第3期之收益分配 = 10,000 美元  $\times$  21.15% = 2,115 美元
- 第4期， $h=4$   
 $R_4 = \text{Min} \{ \text{Max} [ (100\% \times 1.3030 - 110\%), 0\% ], 100\% \} = 20.30\%$   
 第4期之收益分配 = 10,000 美元  $\times$  20.30% = 2,030 美元
- 第5期， $h=5$   
 $R_5 = \text{Min} \{ \text{Max} [ (100\% \times 1.3280 - 110\%), 0\% ], 100\% \} = 22.80\%$   
 第5期之收益分配 = 10,000 美元  $\times$  22.80% = 2,280 美元
- 第6期， $h=6$   
 $R_6 = \text{Min} \{ \text{Max} [ (100\% \times 1.3500 - 110\%), 0\% ], 100\% \} = 25.00\%$   
 第6期之收益分配 = 10,000 美元  $\times$  25.00% = 2,500 美元

「結構型債券到期金」計算步驟如下：

$$\begin{aligned}
 \text{「結構型債券到期金」} &= \text{「結構型債券淨投資金額」} \times \text{MAX}[1 + \text{最低保證投資報酬率}, BP_{\text{end}}, BP_{\text{sup}} \times PR_{\text{sup}}] \\
 &= 10,000 \text{ 美元} \times \text{MAX}[1 + \text{最低保證投資報酬率}, BP_6, BP_{\text{sup}} \times PR_{\text{sup}}] \\
 &= 10,000 \text{ 美元} \times \text{MAX}[1 + 10\%, 1.35, 1.4020 \times 80\%] \\
 &= 10,000 \text{ 美元} \times 135\% \\
 &= 13,500 \text{ 美元}
 \end{aligned}$$

『第十種計算公式』

「結構型債券到期金」=「結構型債券淨投資金額」×[1+Max(投資組合成長率×參與率, 最低保證投資報酬率)]

其中：

一、「參與率」及「最低保證投資報酬率」隨結構型債券之不同而不同，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

二、投資組合成長率計算公式如下：

$$\text{投資組合成長率} = \sum_{h=1}^T \text{Portfolio}_h$$

$$\text{Portfolio}_h = \text{Min} \left\{ C, \sum_{n=1}^N W_n^h \times \left( \frac{\text{Underlying}_n^h - \text{Underlying}_n^{h-1}}{\text{Underlying}_n^{h-1}} \right) \right\}$$

其中

$T$ ：「結構型債券投資期間」總期數， $T = \sum_{i=1}^H M_i$ 。

$H$ ：結構型債券之投資期間（年數）。

$M_i$ ：第  $i$  年度中之期數， $M_i = 12 / t_{mi}$ 。

$t_{mi}$ ：第  $i$  年度中每一期期間之月數（於每次銷售結構型債券時決定，可能為 1 個月、2 個月、3 個月、6 個月或 12 個月）。

第  $h$  期：係指自「結構型債券發行日」起以每  $t_{mi}$  個月為一期之週期；例如，假設每年以 3 個月為一期（ $t_{mi} = 3$ ， $M_i = 4$ ），而 2007/1/15 為「結構型債券發行日」，則第一期之期間為 2007/1/15 至 2007/4/14，第二期之期間為 2007/4/15 至 2007/7/14，以此類推；但每一期之期初及期末需為結構型債券評價日，若非結構型債券評價日時則需遞延至次一結構型債券評價日。

結構型債券評價日：係指該結構型債券所連結之標的所屬報價市場共同之營業日。

$\text{Portfolio}_h$ ：第  $h$  期之投資績效。

$C$ ：每一期投資績效之報酬率上限。

$N$ ：連結之標的個數。

$W_n^h$ ：第  $n$  個標的於第  $h$  期所佔之權重； $\sum_{n=1}^N W_n^h = 1$ 。

$\text{Underlying}_n^0$ ：第  $n$  個連結標的於「結構型債券發行日」之收盤值。

$\text{Underlying}_n^h$ ：第  $n$  個連結標的於第  $h$  期期末前  $dh$  個結構型債券評價日之收盤值。

$dh$ ：此參數為固定數值，於每次銷售結構型債券時決定，本公司最晚在「結構型債券發行日」後一個月內以書面方式通知要保人。

三、範例說明

（本範例說明僅為使要保人更加了解「結構型債券到期金」之計算方式，其引用數字僅做參考，不代表未來實際情況。）

【假設】

1. 1998 年 6 月 30 日為投入 6 年期（ $H = 6$ ）結構型債券之發行日，「結構型債券淨投資金額」為 10,000 歐元；
2. 自「結構型債券發行日」起每 3 個月為一週期（ $t_{mi} = 3$ ， $M_i = 12 / t_{mi} = 12 / 3 = 4$ ， $T = \sum_{i=1}^H M_i = \sum_{i=1}^6 4 = 24$ ）；
3. 連結之標的為 3 支股票（ $N = 3$ ），每期之投資績效權重為 3 支股票之績效平均（ $W_1^h = W_2^h = W_3^h = 1/3$ ）；
4.  $C = 8.5\%$ ，參與率為 100%，6 年期滿最低保證投資報酬率為 23%， $dh = 0$  連結指數之各期期初及期末收盤指數如下：

| 期數 $h$         | 期末日期       | S&P500 指數 | DJ EUROSTOXX50 指數 | TOPIX 指數 | $Portfolio_h$ |
|----------------|------------|-----------|-------------------|----------|---------------|
| 「結構型債券發行日」收盤指數 |            |           |                   |          |               |
|                | 1998/6/30  | 1133.84   | 3406.82           | 1230.38  |               |
| 每期期末收盤指數       |            |           |                   |          |               |
| 1              | 1998/9/30  | 1017.01   | 2670.97           | 1043.57  | -15.70%       |
| 2              | 1998/12/30 | 1231.93   | 3342.32           | 1086.99  | 8.50%         |
| 3              | 1999/3/30  | 1300.75   | 3523.24           | 1269.24  | 8.50%         |
| 4              | 1999/6/30  | 1372.71   | 3788.66           | 1416.2   | 8.21%         |
| 5              | 1999/9/30  | 1282.71   | 3669.71           | 1506.83  | -1.10%        |
| 6              | 1999/12/30 | 1464.47   | 4904.46           | 1722.2   | 8.50%         |
| 7              | 2000/3/30  | 1487.92   | 5251.97           | 1712.45  | 2.71%         |
| 8              | 2000/6/30  | 1454.6    | 5145.35           | 1591.6   | -3.78%        |
| 9              | 2000/10/2  | 1436.23   | 4961.88           | 1491.68  | -3.70%        |
| 10             | 2001/1/4   | 1333.34   | 4752.71           | 1280.94  | -8.50%        |
| 11             | 2001/3/30  | 1160.33   | 4185              | 1277.27  | -8.40%        |
| 12             | 2001/7/2   | 1236.72   | 4304.44           | 1286.92  | 3.40%         |
| 13             | 2001/10/1  | 1038.55   | 3208.31           | 1047.03  | -20.04%       |
| 14             | 2002/1/4   | 1172.51   | 3820.42           | 1053.96  | 8.50%         |
| 15             | 2002/4/2   | 1136.76   | 3743.96           | 1068.69  | -1.22%        |
| 16             | 2002/7/1   | 968.65    | 3131.39           | 1028.63  | -11.63%       |
| 17             | 2002/9/30  | 815.28    | 2204.39           | 921.05   | -18.63%       |
| 18             | 2002/12/30 | 879.39    | 2386.41           | 843.29   | 2.56%         |
| 19             | 2003/3/31  | 848.18    | 2036.86           | 788      | -8.25%        |
| 20             | 2003/6/30  | 974.5     | 2419.51           | 903.44   | 8.50%         |
| 21             | 2003/9/30  | 995.97    | 2395.87           | 1018.8   | 4.67%         |
| 22             | 2003/12/30 | 1109.64   | 2750.09           | 1043.69  | 8.50%         |
| 23             | 2004/3/30  | 1127      | 2791.58           | 1175.51  | 5.23%         |
| 24             | 2004/6/30  | 1140.84   | 2811.08           | 1189.6   | 1.04%         |

各期績效之計算如下：

$$Portfolio_1 = \text{Min} \left\{ \frac{1}{3} \times \left( \frac{1017.01 - 1133.84}{1133.84} + \frac{2670.97 - 3406.82}{3406.82} + \frac{1043.57 - 1230.38}{1230.38} \right), 8.5\% \right\} = \text{Min}(-15.70\%, 8.5\%) = -15.70\%$$

$$Portfolio_2 = \text{Min} \left\{ \frac{1}{3} \times \left( \frac{1231.93 - 1017.01}{1017.01} + \frac{3342.32 - 2670.97}{2670.97} + \frac{1086.99 - 1043.57}{1043.57} \right), 8.5\% \right\} = \text{Min}(16.81\%, 8.5\%) = 8.5\%$$

.....

$$Portfolio_{24} = \text{Min} \left\{ \frac{1}{3} \times \left( \frac{1140.84 - 1127}{1127} + \frac{2811.08 - 2791.58}{2791.58} + \frac{1189.6 - 1175.51}{1175.51} \right), 8.5\% \right\} = \text{Min}(1.04\%, 8.5\%) = 1.04\%$$

投資組合成長率為 = (-15.70%) + 8.5% + ..... + 5.23% + 1.04% = -0.92%

「結構型債券到期金」 = 「結構型債券淨投資金額」 × [1 + Max(投資組合成長率 × 參與率, 最低保證投資報酬率)]  
= 10,000 歐元 × [1 + Max((-0.92%) × 100%, 23%)]  
= 10,000 歐元 × (1 + 23%) = 12,300 歐元

## 【附件五】完全殘廢程度表

完全殘廢指下列七項殘廢程度之一：

- 1．雙日均失明者。(註1)
- 2．兩上肢腕關節缺失者或兩下肢足踝關節缺失者。
- 3．一上肢腕關節缺失及一下肢足踝關節缺失者。
- 4．一目失明及一上肢關節缺失者或一目失明及一下肢足踝關節缺失者。
- 5．永久喪失咀嚼(註2)或言語(註3)之機能者。
- 6．四肢機能永久完全喪失者。(註4)
- 7．中樞神經系統機能遺存極度障害或胸、腹部臟器機能遺存極度障害，終身不能從事任何工作，經常需醫療護理或專人周密照護者。(註5)

註：

- 1．失明的認定：
  - (1)視力的測定，依據萬國式視力表，兩眼個別依矯正視力測定之。
  - (2)失明係指視力永久在萬國式視力表零點零二以下而言。
  - (3)以自傷害之日起經過六個月的治療為判定原則，但眼球摘出等明顯無法復原之情況，不在此限。
- 2．喪失咀嚼之機能係指因器質障害或機能障害，以致不能作咀嚼運動，除流質食物外，不能攝取者。
- 3．喪失言語之機能係指後列構成語言之口唇音、齒舌音、口蓋音、喉頭音等之四種語音機能中，有三種以上不能構音者。
- 4．所謂機能永久完全喪失係指經六個月以後其機能仍完全喪失者。
- 5．因重度神經障害，為維持生命必要之日常生活活動，全須他人扶助者。