

## 結構式債券連結股票股價調整事件說明

### ■ 股票名稱-大東電報局集團/ Cable & Wireless PLC (彭博代碼：CW/ LN)

大東電報局集團於 2010 年 3 月 26 日宣佈完成企業整併。

為反應上述企業整併事件連帶影響到以該股票為標的資產之衍生性金融商品價值，投資銀行將大東電報局集團的投資起始日價格維持不變的同時，自 2010 年 3 月 26 日起將對大東電報局集團之股價進行調整。

### ■ 股價調整公式如下

$$P_{\text{調整後}} = P_{\text{調整前}} * \text{股價調整比例}$$

以上，

$$P_{\text{調整後}} = \text{大東電報局集團調整後股價}$$

$$P_{\text{調整前}} = \text{大東電報局集團調整前股價}$$

### ■ 計算範例

結構式債券名稱：中國人壽輕鬆致富戊型第六期 8 年期

債券發行日：2004 年 4 月 16 日

觀察日：2012 年 4 月 5 日

$$\text{大東電報局集團於觀察日之股價} = P_{\text{調整前}} = 34.48$$

$$\text{股價調整比例} = 1.61516967$$

自 2010 年 3 月 26 日起，該結構式債券所連結之大東電報局集團觀察日調整後股價為：

$$P_{\text{調整後}} = P_{\text{調整前}} * \text{股價調整比例} = 34.48 * 1.61516967 = 55.6910502$$