

XA170101 【吉利豐收16】法國興業10年期美元計價（發行機構可買回）連結利率利差結構型商品（無擔保及無保證機構 / XS1526267114 配息資料

商品名稱	XA170101 【吉利豐收16】法國興業10年期美元計價（發行機構可買回）連結利率利差結構型商品（無擔保及無保證機構
發行日	20-Jan-2017
到期日	20-Jan-2027
計息期間開始日	20-Jul-2019 (Inclusive)
計息期間結束日	20-Oct-2019 (Exclusive)
每季配息計算	6 * (參考標的1 - 參考標的2)*(90/360) 受限於每季配息率上限1.5%(即年利率6%), 每季配息率下限0%(即年利率0%)
參考標的1	美元10年期固定期限交換利率 ("USD CMS 10Y")
參考標的2	美元2年期固定期限交換利率 ("USD CMS 2Y")
本季配息率 (因結算機構進位規則不同, 實際之配息率及/ 或配息金額與本配息報告上所載之配息率及/ 或配息金額可能有所差異。)	0.2505000% (Flat)

參考標的	參考標的	固定期限交換利率定價	固定期限交換利率定價日期
1	USD CMS 10 Years	2.038%	15-Jul-19
2	USD CMS 2 Years	1.871%	15-Jul-19

備註:

1. 美元10年期固定期限交換利率(USD CMS 10Y)係指於各計息期間開始前五個營業日於紐約時間每日上午11時於路透社「ICESWAP1」頁面上發佈之美元10年期固定期限交換利率定價。
2. 美元2年期固定期限交換利率(USD CMS 2Y)係指於各計息期間開始前五個營業日於紐約時間每日上午11時於路透社「ICESWAP1」頁面上發佈之美元2年期固定期限交換利率定價。
3. 固定期限交換利率(Constant Maturity Swap/CMS):係指以交換利率(Swap rate)為指標,但期限固定;舉例:若以美元10年期固定期限交換利率(USD CMS10Y)為參考標的,則在整個商品存續期間都是以10年期美元交換利率 (10Y USD Swap Rate)作為參考標的。

Important Information

The information contained in this document are based on market data at a given moment and are subject to market variations. Past performance is not guarantee of future returns. None of Société Générale, its affiliates and their respective directors, officers, employees or agents gives any representation or warranty as to the reliability, completeness, timeliness, accuracy or fitness for any purpose of the information contained herein, nor does any of them accept any responsibility or liability for any loss or damage arising in any way (including by reason of negligence) out of errors or misstatements in, omissions from, or the reliance of any person on, the information. Nothing herein shall constitute any offer to buy or sell, or a solicitation of an offer to buy or sell any products mentioned herein.