

具損失吸收能力債券(TLAC)買賣風險預告書

本風險預告書係依據金融監督管理委員會及中華民國證券商業同業公會相關規定訂定。

投資人於交易前，應(1)確認自身是否符合主管機關所訂專業投資人之資格條件；(2)審慎評估自身之財務能力與經濟狀況是否適於投資此商品；(3)瞭解投資該債券可能產生之潛在風險，並特別注意下列事項：

具損失吸收能力(Total Loss-Absorbing Capacity；TLAC)債券：係為保護公眾利益或發行人因資產不足以抵償債務、不能支付其債務或有損及存款人利益之虞等業務、財務狀況顯著惡化之情事，須依註冊地國主管機關指示以減記本金或轉換為股權方式吸收損失性質之債券¹。該債券發行機構屬於全球重要的系統性銀行之一，其所發行的債券屬 TLAC 債務工具，當發行機構出現重大營運或破產危機時，得以契約形式或透過法定機制將債券減記面額或轉換股權，可能導致客戶部分或全部債權減記、利息取消、債權轉換股權、修改債券條件如到期日、票息、付息日、或暫停配息等變動。

本風險預告書之預告事項甚為簡要，亦僅為列示性質，因此對所有投資風險及影響市場行情之因素無法逐項詳述，委託人於交易前，除已對本風險預告書詳加研讀外，對其他可能影響之因素亦須慎思明辨，並確實評估風險，以免因交易遭受難以承受之損失。

本人業於委託買賣具損失吸收能力債券(TLAC)前收受及詳讀本風險預告書，並經 貴公司指派專人解說，對上述說明事項及投資具損失吸收能力債券(TLAC)交易之風險已充分明瞭，並承諾自行負責投資風險，特此聲明。

此致 國泰綜合證券股份有限公司

委託人簽章：_____ (原留印鑑)

委託人身分證字號：_____

分公司：_____

營業員：_____

核 印：_____

日期：民國_____年_____月_____日

(風險預告書一式二份，一份由證券商留存備查；另一份交由委託人存執)

¹ 參照財團法人中華民國證券櫃檯買賣中心外幣計價國際債券管理規則第6條之2規定。