

國泰世華銀行

「地方資產管理專區」特定金錢信託受益權質借放款維持率標準公告

壹、信託財產投資於各類標的之個別維持率標準(下稱維持率)如下所示，表內所揭露評等符號係以標準普爾(Standard & Poor's，簡稱 S&P)評等結果為範例：

1.我國中央政府公債

(1)債券剩餘期間 3 年(含)以內

評等 維持率	S&P AAA	S&P AA-(含)以上	S&P A-(含)以上	S&P BBB+(含)以下
預警維持率	103%	107%	112%	119%
追繳維持率	100%	102%	106%	113%

(2)債券剩餘期間 3 年(不含)~11 年(含)

評等 維持率	S&P AAA	S&P AA-(含)以上	S&P A-(含)以上	S&P BBB+(含)以下
預警維持率	107%	112%	119%	127%
追繳維持率	102%	106%	113%	120%

(3)債券剩餘期間逾 11 年

評等 維持率	S&P AAA	S&P AA-(含)以上	S&P A-(含)以上	S&P BBB+(含)以下
預警維持率	116%	124%	133%	143%
追繳維持率	108%	115%	123%	132%

2.國家主權債券、超國家組織債券

(1)債券剩餘期間 3 年(含)以內

評等 維持率	S&P AAA	S&P AA-(含)以上	S&P A-(含)以上	S&P BBB+(含)以下
預警維持率	103%	107%	112%	119%
追繳維持率	100%	102%	106%	113%

(2)債券剩餘期間 3 年(不含)~11 年(含)

評等 維持率	S&P AAA	S&P AA-(含)以上	S&P A-(含)以上	S&P BBB+(含)以下
預警維持率	107%	112%	119%	127%
追繳維持率	102%	106%	113%	120%

(3)債券剩餘期間逾 11 年

評等 維持率	S&P AAA	S&P AA-(含)以上	S&P A-(含)以上	S&P BBB+(含)以下
預警維持率	116%	124%	133%	143%
追繳維持率	108%	115%	123%	132%

3. 公司債券

(1) 債券剩餘期間 11 年(含)以內

評等 維持率	S&P AAA	S&P AA-(含)以上	S&P A-(含)以上	S&P BBB+(含)以下
預警維持率	107%	112%	119%	127%
追繳維持率	102%	106%	113%	120%

(2) 債券剩餘期間逾 11 年

評等 維持率	S&P AAA	S&P AA-(含)以上	S&P A-(含)以上	S&P BBB+(含)以下
預警維持率	123%	131%	142%	153%
追繳維持率	112%	120%	129%	140%

4. 金融債券(含次順位債)、永續債券

(1) 債券剩餘期間 11 年(含)以內

評等 維持率	S&P AAA	S&P AA-(含)以上	S&P A-(含)以上	S&P BBB+(含)以下
預警維持率	107%	112%	119%	127%
追繳維持率	102%	106%	113%	120%

(2) 債券剩餘期間逾 11 年

評等 維持率	S&P AAA	S&P AA-(含)以上	S&P A-(含)以上	S&P BBB+(含)以下
預警維持率	123%	131%	142%	153%
追繳維持率	112%	120%	129%	140%

5. 基金

商品風險等級	防禦型	保守型	穩健型
預警維持率	116%	124%	133%
追繳維持率	108%	115%	123%

貳、維持率標準=【新臺幣/外幣】受益權總市值÷【新臺幣/外幣】特定金錢信託授信餘額×100%。
 受益權總市值=各檔(個別質借標的數量×個別質借標的市價+個別質借標的之發行機構提前買回/現金收購/換券要約之債券數量×個別質借標的市價)合計數。
 質借標的市價=質借標的最近日參考報價或淨值,若屬提前買回/現金收購/換券要約之債券標的,則為交易價格。