|  |  |
| --- | --- |
| **法商法國興業銀行股份有限公司發行**  **新光金融控股股份有限公司普通股認購權證銷售辦法公告** | |
| 發行人法商法國興業銀行股份有限公司 ([金融監督管理委員會109年5月18日金管證字第1090338458號函認可發行認購(售)權證資格在案])發行新光金融控股股份有限公司普通股認購權證。計5,000,000單位，採自行銷售方式辦理對外公開銷售。 | |
| 一、**發行條款:** | |
| (一) | **發行日期**：中華民國112年5月11日。 |
| (二) | **存續期間**：自上市買賣日(含)起算，存續期間九個月，到期日如適逢國定例假日，則順延至次一營業日。 |
| (三) | **標的**：新光金融控股股份有限公司普通股。 |
| (四) | **權證種類**：歐式價外認購權證。 |
| (五) | **發行該標的原因**：發行人根據新光金融控股股份有限公司的財務狀況及持續變化的市場環境以及針對不同的履約條件、存續期間及認購認售等發行新條件，提供投資人多元投資槓桿工具以作選擇。 |
| (六) | **發行單位總數**：共發行5,000,000單位。 |
| (七) | **發行金額**：新台幣3,450,000元整。 |
| (八) | **發行條件**： |
|  | **1. 發行價格：**新台幣0.6900元，依發行日前一營業日標的收盤價之8.0986%訂定。 |
|  | **2. 履約價格：**新台幣9.5000元 (價外發行)，依發行日前一營業日標的證券收盤價之111.5023%訂定。 |
|  | **3. 履約期間：**本認購權證到期日。 |
|  | **4. 每單位代表股份：**1:1.0000；即本權證每單位可認購1.0000股之標的。 |
|  | **5. 溢價及槓桿效果 :** 溢價為8.0986%，槓桿效果為12.35倍。 |
|  | **6. 履約方式: 現金結算。** |
|  | **7. 評價模型:** 採Black&Scholes 為本權證之評價模型**。** |
|  | **8. 計算說明:**   |  |  |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | | 權證名稱 | 發行日期 | 存續期間 | 計算使用之標的價格(新台幣) | 履約價格(新台幣) | 利率 | 波動率 | | 新光金法興32購01 | 112年5月11日 | 九個月 | 8.5200 | 9.5000 | 1.4543% | 35.0000% |   **9.** 最近一年來以同一標的所發行之認購(售)權證比較：   |  |  |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | | 權證名稱 | 發行日期 | 存續期間 | 計算使用之標的價格(新台幣) | 履約價格(新台幣) | 利率 | 波動率 | | 新光金元大25購01 | 111年5月11日 | 十二個月 | 9.1800 | 9.5000 | 1.5000% | 40.0000% | | 新光金元大28購01 | 111年5月12日 | 十五個月 | 9.0800 | 9.5000 | 1.5000% | 50.0000% | | 新光金富邦26購01 | 111年8月24日 | 十個月 | 8.9100 | 9.5000 | 0.9640% | 38.0000% | | 新光金凱基26購01 | 111年9月19日 | 九個月 | 8.6900 | 9.5000 | 1.0000% | 30.9900% | | 新光金麥證26購01 | 111年9月29日 | 八個月 | 8.1200 | 9.5000 | 1.0900% | 35.5000% | | 新光金康和26售01 | 111年9月30日 | 八個月 | 8.3000 | 9.5000 | 2.5000% | 45.0000% | | 新光金元大26購01 | 111年10月17日 | 八個月 | 8.0000 | 9.5000 | 1.5000% | 38.0000% | | 新光金麥證25售01 | 111年11月10日 | 六個月 | 8.3000 | 9.5000 | 1.2600% | 39.0000% | | 新光金麥證25購02 | 111年11月17日 | 六個月 | 8.5100 | 9.5000 | 1.2600% | 38.0000% | | 新光金康和28購01 | 111年12月1日 | 八個月 | 8.9100 | 9.5000 | 2.5000% | 35.0000% | | 新光金兆豐28購01 | 111年12月2日 | 八個月 | 8.9000 | 9.5000 | 1.5000% | 35.0000% | | 新光金國票26購01 | 111年12月5日 | 六個月 | 8.8600 | 9.5000 | 1.0000% | 32.0000% | | 新光金富邦2A購01 | 111年12月6日 | 十個月 | 8.8400 | 9.5000 | 0.9640% | 68.0000% | | 新光金中信26購01 | 111年12月8日 | 六個月 | 8.7700 | 9.5000 | 1.5000% | 32.0000% | | 新光金中信29購01 | 111年12月8日 | 九個月 | 8.7700 | 9.5000 | 1.5000% | 36.0000% | | 新光金群益28購01 | 111年12月16日 | 八個月 | 8.7400 | 9.5000 | 1.0000% | 35.0000% | | 新光金中信28售01 | 111年12月21日 | 八個月 | 8.7400 | 9.5000 | 1.5000% | 44.0000% | | 新光金法興29購01 | 112年1月10日 | 八個月 | 8.9600 | 9.5000 | 1.3870% | 38.0000% | | 新光金元大27購01 | 112年1月13日 | 六個月 | 8.8200 | 9.5000 | 1.5000% | 35.0000% | | 新光金元大29購01 | 112年2月16日 | 七個月 | 8.7100 | 9.5000 | 1.5000% | 36.0000% | | 新光金凱基29購01 | 112年2月17日 | 七個月 | 8.7000 | 9.5000 | 1.0000% | 34.0900% | | 新光金中信2A購01 | 112年3月17日 | 七個月 | 8.0100 | 9.5000 | 1.5000% | 40.0000% | | 新光金元大29售02 | 112年3月27日 | 六個月 | 8.3000 | 9.5000 | 1.5000% | 48.0000% | | 新光金麥證2A售01 | 112年4月26日 | 六個月 | 8.4000 | 9.5000 | 1.5000% | 43.0000% | | 新光金麥證31購01 | 112年5月9日 | 八個月 | 8.4200 | 9.5000 | 1.4700% | 38.0000% | |
| (九) | 發行人於權證項下所有的付款責任由發行人之子公司SG Option Europe無條件及不可撤銷地擔保。倘發行人無法支付現金結算金額，SG Option Europe將代為支付。若投資人購買本認購權證，該投資人將被視為已同意本文件所載之所有條款。 |
| 二、 | **流動量提供者相關事項：** |
|  | **1.流動量提供者之名稱：**法商法國興業銀行股份有限公司。  **2.履行報價責任之方式：**主動報價。  **3.不提供報價之時機：**  (1) 集中交易市場開盤後五分鐘內。  (2) 開市前時段或臺灣證券交易所指定的任何其他情況。  (3) 權證或權證之標的暫停交易。  (4) 有關標的的期權或期貨合約的買賣出現或存在任何暫停或限制。  (5) 當流動量提供者專戶內之權證數量無法滿足每筆報價最低賣出單位時，流動量提供者僅申報買進。  (6) 標的價格漲停時，認購（售）權證得僅申報買進（賣出）價格； 標的價格跌停時，認購（售）權證得僅申報賣出（買進）價格。認購（售）權證價格漲停時，認購（售）權證得僅申報買進價格；認購（售）權證價格跌停時，認購（售）權證得僅申報賣出價格。  (7) 權證理論價值低於新台幣0.01元的權證。  (8) 流動量提供者在日常運作出現技術性問題時。  (9) 當發行人無法進行避險時。  (10) 權證距到期日十五個交易日以內，流動量提供者得僅申報買進。  (11) 價內程度超過 30% (含)之權證，僅申報買進價格。  (12) 權證得不報賣價時機：  個股型權證、電子指數權證或金融指數權證：標的20天交易日歷史波動率超過權證最佳委買價格隱含波動率達5%；  台股指數權證：期交所每分鐘公告之臺指選擇權波動率指數(VIX)超過權證最佳委買價格隱含波動率達3%。  **4.** **流動量提供者應主動每隔五分鐘至少報價一次，而此報價應至少維持三十秒，但因標的委託價量變動而更新報價者，則不受應維持三十秒之限制。流動量提供者應訂定最高申報買進價格與最低申報賣出價格間最大為十個升降單位。權證每筆買進報價不得低於一百交易單位或總金額應達壹拾萬元以上。但有下列各情事之一者，得不受其限制，惟不得低於十交易單位：**  (1)現股流動性不足時。現股流動性不足意係指當本檔權證買進報價之每一百交易單位乘上行使比例高於標的證券委買或委賣張數之百分之五十時。  (2)標的證券為處置股票時。  (3)開盤後五分鐘至十五分鐘及收盤前五分鐘。權證每筆賣出報價不得低於十交易單位。 |
|  | **5.權證報價時所使用之剩餘天數計算方式：** |
|  | 剩餘時間以交易日數計算，交易日數計算方式為權證發行時已知的股市營業日期。 |
|  | **6.日內委買權證報價波動率之最大變動比率：** |
|  | 權證日內委買波動率調降不得超過1%，權證日內委買波動率調升則不受限制，惟調升後再行調降者，同樣調降不得超過1%。但有下列各情事之一者，得不受其限制。  (1) 權證價內程度超過25%，及價外程度超過25%且最佳一檔委託買進價格小於0.6元者；  (2) 權證距到期日小於15個營業日者；  (3) 權證符合不報價時機者；  (4) 權證價格變動1個升降單位造成報價波動率差異超過0.5%者；  (5) 權證理論買進價格經小數點進退位至實際買進價格而造成波動率差異者；  (6) 前一日收盤無流通在外之權證。 |
| 三、 | **銷售辦法:** |
|  | 1. 銷售方式：由香港商法國興業證券股份有限公司台北分公司自行銷售，一般投資人可於權證上市後於臺灣證券交易所買賣交易。 |
|  | 1. 銷售地點：香港商法國興業證券股份有限公司台北分公司。 |
| 四、 | **權證之上市:** |
|  | 1. 本認購權證於臺灣證券交易所掛牌交易。   (2) 本認購權證預定於中華民國112年5月15日上市買賣，實際上市日期以臺灣證券交易所核定為準。 |
| 五、 | **上市後之買賣:** |
|  | 1. 本認購權證於上市後應在交易市場交易，其交易方式及程序均依臺灣證券交易所之規定。 2. 買賣本認購權證應依法繳交證券交易稅捐，並依臺灣證券交易所規定繳付手續費。 |
| 六、 | **上市後之履約：**   1. 履約方式：自動履約，持有人無需交付任何履約通知。 2. 履約時間：**於到期日權證採用到期價內自動現金結算方式結算**。 3. 履約數量：應為1,000單位或其整數倍。 |
| 七、 | **權證存續期間屆滿之效力：**  存續期間屆滿時，處於價內狀態有行使價值者，如其履約條款訂為現金結算者，視為持有人已有行使認購（售）權證並得請求履約之意思表示。價外權證失其效力，發行人對權證不再負任何責任。 |
| 八、 | **發行人之信用評等資料**：  標普環球評級公司於民國111年12月14日確認發行人之信貸評級為A。  (報告由信貸評級機構所發佈，[英文本點選此處](https://www.societegenerale.com/en/measuring-our-performance/investors/debt-investors/ratings)。） |
| 九、 | **發行人於未來三個月內對同一標的發行反向之認售權證**  為因應市場變動及提供投資人多樣化的投資工具，發行人不排除於未來三個月內對同一標的反向發行認售權證。 |
| 十、 | **特別聲明：** |
|  | 1. 本認購(售)權證購買人應事先了解認購(售)權證之相關法令及臺灣證券交易所與集保結算所之相關規定，並詳閱本發行計畫與公開銷售說明書，購買本認購(售)權證後，即受相關規定及本發行計畫與公開銷售說明書內容之拘束，不得以不知相關規定及發行計畫與公開銷售說明書為由，提出任何主張。 2. 權證具高度風險，欲購買者應了解權證可能在到期時不具任何價值，並有損失購買價金之心理準備。 |
| 十一、 | **準據法**  本權證之發行所生之一切爭議，應適用之準據法為中華民國法律。 |
| 十二、 | **管轄**  因本次權證所生一切爭議，以臺灣臺北地方法院為第一審管轄法院。 |
| 十三、 | **發行人簽證會計師**  會計師姓名：Micha Missakian與Vincent Roty  事務所名稱：Ernst & Young et Autres  地址：Tour First, TSA 14444, 92037 Paris-La Défense Cedex, France  電話：+33 1 46 93 60 00  會計師姓名：Jean-Marc Mickeler與Maud Monin  事務所名稱：Deloitte & Associés  地址：6, place de la Pyramide, 92908 Paris-La Défense Cedex, France  電話：+33 1 40 88 28 00 |
| 十四、 | **出具本權證法律意見書之律師**  律師姓名：黃韻如律師  事務所名稱：中道法律事務所  地址：台北市敦化北路102號12樓  電話：+886-2-27175356 |