

雷曼連動債訊息公告

主旨：雷曼控股公司向破產法院提出之提議承認債權金額經破產法院核准。內容如說明。

說明：

一、結構型證券通知：雷曼控股公司（以下稱「雷曼公司」）於2011年8月底對本公司發出結構型證券通知，表示已對結構型債券債權（下稱「結構型證券債權」）向破產法院提出提議承認債權金額（如後附件）。結構型證券通知內所載金額，係雷曼公司以結構型證券債權之最大可承認債權金額之方法（下稱「結構型證券評價方法」）計算得出。本聲請於2011年8月10日經破產法院核准。

二、對結構型證券通知之回覆：依結構型證券通知所述，若債權人同意該通知所載之提議承認債權金額或並不希望就該金額提出爭執，則**不需要**對個別結構型證券通知提出書面回覆。如債權人未就其結構型證券通知提出書面回覆，則該債權人將被視為同意重整計畫下為表決及分配目的之提議承認債權金額。

若債權人不同意結構型證券通知內所載提議承認債權金額，則應於**2011年10月25日下午4:00前**，對該通知提出書面回覆。

三、本公司基於下列考量，將不對結構型證券通知提出回覆表示爭執：(i) 準備回覆及協商承認債權金額之法律成本與因協商可得之潛在獲償金額相較不符合成本效益，及(ii) 提出書面回覆可能導致與雷曼公司間相當耗費時間的協商及訴訟，而最終可能造成遲延獲得分配。

本公司將持續關注本案件之進度及發展，並提供重大訊息予投資人知悉。

附件 雷曼控股公司提議承認債權金額

Exhibit A

Claim # 32528
CAPITAL SECURITIES CORP.

Calculation of Proposed Allowed Claim Amount

A	B	C	D	E	F	G
Structured Security, by ISIN	Blocking Number	Maximum Allowable Amount ²	Percentage of Notional Amount for which Blocking Numbers were Issued by Clearing Agencies	Aggregate Amount Distributable to Claims Based on Relevant ISIN (Equals the Product of C x D with slight differences due to rounding)	Claimant's Percentage of Notional Amount for Which Blocking Numbers were Issued by Clearing Agencies	PROPOSED ALLOWED CLAIM AMOUNT (Equals the Product of E x F with slight differences due to rounding)
XS0363444406	6005089	\$2,403,300.68	93.1034%	\$2,237,555.81	100.0000%	\$2,237,555.81
XS0309813839	6005090	\$2,216,589.87	100.0000%	\$2,216,589.87	71.5147%	\$1,585,186.81
XS0289701962	6005091	\$5,899,602.50	96.9866%	\$5,721,823.31	11.4960%	\$657,783.01
Aggregate Proposed Allowed Claim Amount:						\$4,480,525.63
Claim Amount, as filed (portion based on Structured Security only):						\$4,879,651.17