



## 附錄 D

### 在仍未贖回的迷你債券系列的發行章程內的主要披露事項

系列	發行章程的刊發年月	債券並不保本	投資者可能損失部分甚至全部投資	債券並非適合所有人	相關主體的信貸風險；信貸事件贖回金額可能遠低於原本的投資額	掉期對手享有優先權（如適用）；有限追索權	發生信貸事件後贖回	債券如發生違約事件會被提早贖回	如抵押品或其相關證券須予償還或提前償還（如基於稅務原因），將贖回債券	如開曼群島向發行人或債券徵稅，將提早贖回債券	如掉期安排被終止（如基於若干破產相關事件），將提早贖回債券	抵押品貶值；贖回金額可能遠低於原本的投資額	因抵押債務證券抵押品減值而提早贖回債券或按比例減少迷你債券的本金額	欠缺流通的買賣市場或售回價值偏低
5	03年6月	封面頁、第26頁	封面頁、第3、26頁	-	第5頁	封面頁、第11、26、47頁（無掉期安排）	第5頁（見附註B）	第14頁	-（見附註C、第7及14頁）	第12頁	不適用（無掉期安排）	-	不適用（見附註D）	封面頁、第28頁
6	03年9月	不適用（信貸事件僅影響利率）	不適用（信貸事件僅影響利率）	-	第57頁（信貸事件僅影響利率）	第54-55頁（無掉期安排）	不適用（信貸事件僅影響利率）	第36、38頁	第36頁	第36、37頁	不適用（無掉期安排）	-	不適用（見附註D）	第56、90頁
7	03年11月	封面頁	第38頁	-	第42頁	第17、38-39頁（無掉期安排）	封面頁、第6-8頁（見附註B）	第20頁	-（見附註C、第8及17頁）	第17頁	不適用（無掉期安排）	第8-9頁	不適用（見附註D）	第40、79頁
9	04年3月	第41頁	第41頁	-（見附註A）	第8、41、42頁	第8、17、19頁	封面頁、第8頁（見附註B）	第20、23頁	-（見附註C及第11頁）	第20頁	第18、20頁	第12頁	不適用（見附註D）	第41、44頁



系列	發行章程的刊發年月	債券並不保本	投資者可能損失部分甚至全部投資	債券並非適合所有人	相關主體的信貸風險；信貸事件贖回金額可能遠低於原本的投資額	掉期對手享有優先權（如適用）；有限追索權	發生信貸事件後贖回	債券如發生違約事件會被提早贖回	如抵押品或其相關證券須予償還或提前償還（如基於稅務原因），將贖回債券	如開曼群島向發行人或債券徵稅，將提早贖回債券	如掉期安排被終止（如基於若干破產相關事件），將提早贖回債券	抵押品貶值；贖回金額可能遠低於原本的投資額	因抵押債務證券抵押品減值而提早贖回債券或按比例減少迷你債券的本金額	欠缺流通的買賣市場或售回價值偏低
10	04年5月	第41頁	第41、42頁	-（見附註A）	第10、42頁	第8、19頁	封面頁、第9頁（見附註B）	第20頁	第11頁	第20、22頁	第18、20、22頁	第11頁	第11頁（見附註B）	第41、44頁
11	04年6月	第39頁	第39、40頁	-（見附註A）	第9、11、40頁	第8、18頁	封面頁、第9頁（見附註B）	第19、21頁	第11頁	第19、21頁	第17、19、21頁	第11頁	第11頁（見附註B）	第39、43頁
12	04年8月	封面頁	第40頁	-（見附註A）	第8、10、41頁	第7、18頁	封面頁、第7、8頁（見附註B）	第19、21頁	第10頁	第19、21頁	第17、19、21頁	第10頁	第10頁（見附註B）	第40、43頁
15	04年11月	封面頁、第43頁	第43頁	-（見附註A）	第7、8、44頁	第7、17、19頁	第7、8頁（見附註B）	第20、24頁	第10、20、22、46、48頁	第20、21頁	第18、20、50頁	第46頁	第11、15、23、46、48頁（見附註B）	第43、47頁
16	04年12月	封面頁、第42頁	第42頁	-（見附註A）	第7、8、43頁	第7、17、19頁	第7、8頁（見附註B）	第20、24頁	第10、20、22、45頁	第20頁	第18、20、49頁	第45頁	第10、15、23、45、47頁（見附註B）	第42、46頁



系列	發行章程的刊發年月	債券並不保本	投資者可能損失部分甚至全部投資	債券並非適合所有人	相關主體的信貸風險；信貸事件贖回金額可能遠低於原本的投資額	掉期對手享有優先權（如適用）；有限追索權	發生信貸事件後贖回	債券如發生違約事件會被提早贖回	如抵押品或其相關證券須予償還或提前償還（如基於稅務原因），將贖回債券	如開曼群島向發行人或債券徵稅，將提早贖回債券	如掉期安排被終止（如基於若干破產相關事件），將提早贖回債券	抵押品貶值；贖回金額可能遠低於原本的投資額	因抵押債務證券抵押品減值而提早贖回債券或按比例減少迷你債券的本金額	欠缺流通的買賣市場或售回價值偏低
17	05年2月	封面頁	第42頁	-（見附註A）	第7、8、22頁	第7、17、19頁	第7、8頁（見附註B）	第20、24頁	第10、20、22、45頁	第20頁	第18、20、49頁	第45頁	第10、15、23、45、47頁（見附註B）	第42、46頁
18	05年3月	第8、11、13頁	第8、11、13頁	第9頁	第3、7、13、14頁	第14頁	第7、13頁（見附註B）	第8、13頁	第8、13頁	第8、13頁	第8、13頁	第13、14頁	第13頁	第4、14頁
19	05年4月	第8、11、13頁	第8、11、13頁	第9頁	第3、7、13、14頁	第14頁	第7、13頁	第8、13頁	第8、13頁	第8、13頁	第8、13、19頁	第13、14頁	第13頁	第4、14頁
20	06年6月	第8、11、13頁	第8、11、13頁	第9頁	第4、7、13、14頁	第14頁	第7、13頁	第8、13頁	第8、13頁	第8、13頁	第8、13、19頁	第13、14頁	第13頁	第4、14頁
21	05年8月	第8、11、13頁	第8、11、13頁	第9頁	第4、7、13、14頁	第14頁	第4、13頁	第8、13頁	第8、13頁	第8、13頁	第8、13、19頁	第13、14頁	第13頁	第4、14頁
22	05年10月	第9、12、14頁	第9、12、14頁	第10頁	第4、6、8、14頁	第15頁	第4、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14、20頁	第14、15頁	第14頁	第4、15頁
23	06年1月	第8、12、14頁	第9、12、14頁	第10頁	第4、8、14、15頁	第16頁	第4、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14、20頁	第14、15頁	第14頁	第4、15頁



系列	發行章程的刊發年月	債券並不保本	投資者可能損失部分甚至全部投資	債券並非適合所有人	相關主體的信貸風險；信貸事件贖回金額可能遠低於原本的投資額	掉期對手享有優先權（如適用）；有限追索權	發生信貸事件後贖回	債券如發生違約事件會被提早贖回	如抵押品或其相關證券須予償還或提前償還（如基於稅務原因），將贖回債券	如開曼群島向發行人或債券徵稅，將提早贖回債券	如掉期安排被終止（如基於若干破產相關事件），將提早贖回債券	抵押品貶值；贖回金額可能遠低於原本的投資額	因抵押債務證券抵押品減值而提早贖回債券或按比例減少迷你債券的本金額	欠缺流通的買賣市場或售回價值偏低
25	06年3月	第9、12、14頁	第9、12、14頁	第10頁	第4、8、9、14-15頁	第15-16頁	第8、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14、20頁	第14、15頁	第14頁	第4、15頁
26	06年5月	第9、13、15頁	第9、13、15頁	第11頁	第4、8、9、15-16頁	第16-17頁	第8、15頁	第9、15頁	第9、15頁	第9、15頁	第9、15、21頁	第15、16頁	第15頁	第4、16頁
27	06年8月	第9、12、14頁	第9、12、14頁	第10頁	第4、8、9、14-15頁	第15-16頁	第8、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14、20頁	第14、15頁	第14頁	第4、15頁
28	06年9月	第9、12、14頁	第9、12、14頁	第10頁	第4、8、9、14-15頁	第15-16頁	第8、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14、20頁	第14、15頁	第14頁	第4、15頁
29	06年11月	第9、12、14頁	第9、12、14頁	第10頁	第4、8、9、14-15頁	第15-16頁	第8、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14、20頁	第14、15頁	第14頁	第4、15頁
30	07年1月	第9、12、14頁	第9、12、14頁	第10頁	第4、8、9、14-15頁	第15-16頁	第8、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14頁	第9、14、20頁	第14、15頁	第14頁	第4、15頁
31	07年3月	第3、9、12、14、16頁	第9、14、16頁	第11-12頁	第5、8、9、16-17頁	第18頁	第8、16頁	第9、16頁	第9、16頁	第9、16頁	第9、16、22頁	第16、17頁	第16頁	第5、17頁



系列	發行章程的刊發年月	債券並不保本	投資者可能損失部分甚至全部投資	債券並非適合所有人	相關主體的信貸風險；信貸事件贖回金額可能遠低於原本的投資額	掉期對手享有優先權（如適用）；有限追索權	發生信貸事件後贖回	債券如發生違約事件會被提早贖回	如抵押品或其相關證券須予償還或提前償還（如基於稅務原因），將贖回債券	如開曼群島向發行人或債券徵稅，將提早贖回債券	如掉期安排被終止（如基於若干破產相關事件），將提早贖回債券	抵押品貶值；贖回金額可能遠低於原本的投資額	因抵押債務證券抵押品減值而提早贖回債券或按比例減少迷你債券的本金額	欠缺流通的買賣市場或售回價值偏低
32	07年6月	第3、9、12、14、16頁	第9、14、16頁	第11-12頁	第5、8、9、16-17頁	第18頁	第8、16頁	第9、16頁	第9、16頁	第9、16頁	第9、16、22頁	第16、17頁	第16頁	第5、17頁
33	07年7月	第3、9、12、14、16頁	第9、14、16頁	第11-12頁	第5、8、9、16-17頁	第18頁	第8、16頁	第9、16頁	第9、16頁	第9、16頁	第9、16、22頁	第16、17頁	第16頁	第5、17頁
34	07年11月	第3、9、12、14、16頁	第9、14、16頁	第11-12頁	第4、8、9、12、16頁	第18、19頁	第8、16頁	第9、16頁	第9、16頁	第9、16頁	第9、16、22頁	第16、17頁	第16頁	第5、18頁
35	08年1月	第3、9、12、14、16頁	第9、14、16頁	第11-12頁	第4、8、9、16-17頁	第18頁	第8、16頁	第9、16頁	第9、16頁	第9、16頁	第9、16、22頁	第16、17頁	第16頁	第5、18頁
36	08年4月	第3、9、13、15頁	第9、15頁	第11頁	第4、8、9、15、16-17頁	第17、19頁	第8、15頁	第9、15頁	第9、15、17頁	第9、15頁	第9、15、22頁	第16、17頁	第15頁	第5、17頁

附註 A：發行章程內有一段關於債券的銷售對象的陳述。

附註 B：債券不會被提早贖回，而信貸事件贖回金額或違約贖回金額（視屬何情況而定）只會在到期日當天或之後支付。

附註 C：該等章程已載列可導致債券在到期日後被贖回的相關證券的違約事件。

附註 D：抵押品包含 Lehman Brothers Holdings Inc.以相關證券擔保人的身分作擔保的證券。