

CONSTELLATION
系列34-37、43-46、55-58、59-62、63-66、67-70、71-74及78-81債券
(合稱“此等債券”)

與雷曼兄弟控股有限公司有關的信貸事件
常見問題

2008年9月19日

1. 與雷曼兄弟控股有限公司有關的信貸事件是甚麼時候發生的?

與雷曼兄弟控股有限公司有關的信貸事件大約於 2008 年 9 月 15 日發生。

2. 該信貸事件為何?

大約於 2008 年 9 月 15 日雷曼兄弟控股有限公司提出了美國破產法案第 11 章下的自願呈請，而根據此等債券之條款下破產的定義第(iv)節的涵義，已構成一項破產信貸事件。

3. 信貸事件釐定日為何日?

信貸事件釐定日為星展銀行有限公司（作為計價代理）有效發出信貸事件通知及公開可得資料通知予發行人的日期，即 2008 年 9 月 16 日。

4. 估值日為何日及於該日會發生甚麼?

估值日為信貸事件釐定日後第 25 個營業日，因此預期將為 2008 年 10 月 24 日左右。於該日星展銀行有限公司（作為計價代理）將釐定信貸事件贖回款額。

5. 信貸事件贖回日期何日及於該日會發生甚麼?

信貸事件贖回日期為估值日後第 5 個營業日，因此預期將為 2008 年 10 月 31 日左右。於該日發行人會以信貸事件贖回款額贖回每份債券。

6. 此等債券於信貸事件發生後是否仍有利息?

此等債券將自緊接發生該信貸事件之前的付息日起不再計算任何利息。

7. 星展銀行有限公司（作為市場代理）會否繼續為購入此等債券提供報價?

從即時開始，星展銀行有限公司（作為市場代理）停止提供購入此等債券的報價。
