

【ご案内】リーマン・ブラザーズ・ホールディングス・インク傘下各社との取引に関する対応状況

■リーマン・ブラザーズ・ホールディングス・インク傘下各社との取引に関する対応状況

リーマン・ブラザーズ・ホールディングス・インク(LBHI)の米国における倒産手続であるチャプター11の適用申請(2008/9/15)に伴う、同社傘下各社を取引相手とする有価証券の受渡遅延に関しましては、これまで適宜状況をご報告してまいりましたが、旧住友信託銀行の年投合同口G口(現E02口)、H口(現E91口)でのシンガポール株式の取引分に関する動向につきまして、ご報告させていただきます。

※旧中央三井アセット信託銀行の受託ファンドの該当はございません。

【これまでの状況】

(1)当該売買取引については、発注先のLehman Brothers Securities Asia Limited (LBSA)に対し取引キャンセル(売買契約の解除)を行うことにより、受渡遅延状況を解消し、取引キャンセル後に行った取引再構築の投資行動により損失が発生しております。債権届出額及び基準価格への影響度は以下の通りです。

○外国株式E02(旧G口):SGD394,462.00(▲4.0bp)

○外国株式E91(旧H口):SGD10,608.38(▲4.0bp) *()内は、当時の取引再構築後の影響度

(2)当該損失に関して、弊社は香港の裁判所(香港香港特別行政区高等法院)宛てに債権届「Proof of Debt」を提出しました。また、LBHIが傘下子会社の債務を保証する可能性を考慮し、米国破産裁判所に対しても、債権届「Proof of Claim」を提出しました。

(3)2013年7月に清算人(KPMG)より下記内容にて当該届出債権を認可する旨の通知を受領致しました。遅延損害金の一部について弊社の届出債権額から減額されましたが、法令上妥当な内容であり受入れざるを得ないこと(弁護士見解)、それ以外の条件は全て弊社の届出内容が認められたことから、本件認可債権額を応諾致しました。また、通貨につきましても、(弊社の債権届出通貨のSGDではなく)HKDで受入れることはやむを得ないと判断致しました。

なお、弊社は本件取引相手のLBSAおよびLehman Brothers Commercial Corporation Asia Limited (LBCCA)の双方を対象に、同一内容の債権届出を提出しておりましたが、最終的にLBCCAを債務者として確定のうえ認可がありました。

【E02/旧G口】	届出額	認可額	(同SGD換算額)
再売却に伴う損失額	SGD 380,599.49	HKD 1,953,674.27	SGD 380,599.49
遅延損害金	SGD 13,862.51	HKD 64,772.34	SGD 12,618.44
	SGD 394,462.00	HKD 2,018,446.62	SGD 393,217.93

【E91/旧H口】	届出額	認可額	(同SGD換算額)
再売却に伴う損失額	SGD 10,231.01	HKD 52,517.31	SGD 10,231.01
遅延損害金	SGD 377.37	HKD 1,763.27	SGD 343.51
	SGD 10,608.38	HKD 54,280.58	SGD 10,574.52

※SGD/HKD @5.13315(清算開始命令当時のSGD/HKD換算レート)

(4)前回ご報告までの中間配当金・任意弁済金の受領について

左記認可額で債権額が確定された後、これまで以下の中間配当金ならびに任意弁済金が支払われ、認可債権額に対する累積の債権者配当金の支払率は60.3%となっております。

【今回のご報告事項】

(1)中間配当金の受領ならびにファンドへの入金実施について

当四半期は、LBCCAの清算人であるKPMGより第13回目の中間配当金(0.32%)を受領し、各ファンドに入金いたしました。

これまでの配当金、および本任意弁済金等の回収状況は以下をご参照下さい。

(2)今後について

引続き清算手続きの進捗に応じて追加的な配当率が決定され、次回以降の配当金が支払われる見込みです。今後の進捗につきましては、適宜、ご報告させていただきます。なお、今後の配当金入金につきましても、上記と同様の取扱となります。

【これまでの配当金等回収状況】

【E02/旧G口】

入金日	内容	金額(HKD)
2013/12	配当金	528,809.23
2014/4	配当金	137,230.59
2014/6	配当金	141,267.46
2014/8	任意弁済金	784.70
2015/2	配当金	161,451.94
2015/7	配当金	121,083.00
2016/3	配当金	46,400.48
2016/9	配当金	32,271.35
2018/9	配当金	36,308.25
2020/4	配当金	11,077.66
2021/2	配当金	2,196.51
2022/1	配当金	6,541.93
合計		1,225,423.10

(累積支払率 60.7%)

【E91/旧H口】

入金日	内容	金額(HKD)
2013/12	配当金	14,220.87
2014/4	配当金	3,690.44
2014/6	配当金	3,799.00
2014/8	任意弁済金	21.10
2015/2	配当金	4,341.81
2015/7	配当金	3,256.20
2016/3	配当金	1,247.81
2016/9	配当金	867.85
2018/9	配当金	976.41
2020/4	配当金	297.90
2021/2	配当金	59.07
2022/1	配当金	175.93
合計		32,954.39

(累積支払率 60.7%)

以上

※旧G口を引き継いだE44(エンハンスト・インデックス型)は、2015年5月にE02(MSCI-kokusai連動型/レンディング無)に併合されています。