

本公佈僅供參考，並不構成購入、購買或認購下述權證的邀請或要約。

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司（「**聯交所**」）對本公佈的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示概不就因本公佈全部或任何部份內容而產生，或因依賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。

非抵押結構性產品



渣打銀行

（根據《1853年英皇制書》於英國註冊成立的有限公司）
透過其新加坡分行行事
發行之權證之推出公佈

保薦人：渣打銀行（香港）有限公司

（於香港註冊成立的有限公司）

權證詳情

本公司擬發行下列權證（「**權證**」）：

權證 證券代號	28714	28717
流通量提供者經紀 編號	9687	9687
發行額（份權證）	100,000,000	100,000,000
形式	歐式現金結算	歐式現金結算
類別	認沽	認購
指數	恒生中國企業指數	恒生中國企業指數
買賣單位（份權證）	10,000	10,000
每份權證的發行價 （港元）	0.165 元	0.215 元
行使水平	10,400	10,000
指數貨幣金額（港 元）	1 元	1 元
除數	4,500	4,000
推出日（適用於各 系列權證）	2014年7月11日	
發行日（適用於各 系列權證）	2014年7月17日	
上市日（適用於各 系列權證）	2014年7月18日	
估值日 ¹	2015年1月29日	2015年1月29日
到期日 ¹	2015年1月29日	2015年1月29日
引伸波幅*	23.2%	22.5%
實際槓桿比率*	6.64 倍	7.31 倍
槓桿比率*	13.96 倍	12.05 倍
溢價*	6.81%	4.79%

* 以上數據不可與其他在聯交所上市的衍生權證發行人提供的同類資料比較。不同發行人可能採用不同的定價模型。

¹ 倘該日並非相關指數期貨合約於香港期貨交易所有限公司（或其繼任人或受讓人）到期之日，則為相關指數期貨合約於香港期貨交易所有限公司（或其繼任人或受讓人）到期之日。

於到期時的情況如何？

倘現金結算金額大於零，權證將於到期日自動行使。每手買賣單位之現金結算金額將按下列方式以港元計算（如為正數）：

就一系列認購權證而言：

$$\frac{(*收市水平 - 行使水平) \times \text{一手買賣單位} \times \text{指數貨幣金額}}{\text{除數}}$$

就一系列認沽權證而言：

$$\frac{(\text{行使水平} - *收市水平) \times \text{一手買賣單位} \times \text{指數貨幣金額}}{\text{除數}}$$

*「收市水平」指根據香港期貨交易所有限公司（或其繼任人或受讓人）的買賣股票指數期貨合約規例第 012 條及恒生中國企業指數期貨的合約細則（經不時修訂）結算預定於相關權證系列所預定的到期日的所屬月份到期的恒生中國企業指數期貨合約的最終結算價（「指數期貨合約」）。

權證的上市

本公司將向聯交所申請批准權證在聯交所上市及買賣。權證須待獲得是項上市批准後，方可發行。

本人可從哪裏獲得報價？

閣下可要求從下列來源獲取權證之報價：

流通量提供者：	渣打證券（香港）有限公司
地址：	香港中環金融街八號國際金融中心二期十五樓
電話號碼：	+852 3983 8838

本人可從哪裏獲取其他資料？

閣下可於上市日至到期日的任何工作日（星期六、星期日及公眾假期除外）的一般辦公時間內於香港中環金融街八號國際金融中心二期十五樓查閱下列文件（包括英文版本及中文譯本）：

1. 本公司日期為 2014 年 4 月 22 日之基本上市文件；及
2. 日期為發行日或前後之有關補充上市文件。

其他資料

權證之價格可急升亦可急跌，而閣下有關權證之購買價可能會蒙受全盤損失。閣下在決定投資權證前，應仔細考慮權證是否適合閣下之經驗、目標、財務狀況及其他有關情況。

權證構成本公司而非任何其他人士的一般無抵押合約責任，倘若本公司清盤，各權證與本公司的所有其他無抵押責任（法律規定優先的責任除外）具有同等地位。如閣下購買權證，閣下是倚賴本公司的信譽，而根據權證，閣下對指數編製人或任何其他人士並無任何權利。倘若本公司無力償債或未能履行本公司於權證項下的責任，則閣下可能無法收回有關權證的部份或全部應收款項（如有）。

除了為香港金融管理局所規管的持牌銀行外，本公司亦受英國金融市場行為監管局和審慎監理署規管。本公司的長期信貸評級（截至緊接本公佈日期前一日）獲 Standard & Poor's Credit Market Services Europe Limited 評為 AA- 級（前景負面），並獲 Moody's Investors Service Hong Kong Limited 評為 A1 級（前景穩定）。

指數免責聲明

指數乃由恒生指數有限公司（「指數編製人」）根據恒生資訊服務有限公司（「恒生資訊服務」）特許協議發布及編製。「恒生中國企業指數」之標記及名稱由恒生資訊服務擁有。指數編製人及恒生資訊服務已同意本公司可就權證使用及引述指數，惟指數編製人及恒生資訊服務並無就 (i) 指數及其計算或任何其他與之有關的資料的準確性及完整性；或 (ii) 指數或其中任何成份或其所包涵的資料作任何用途之適用性或適合性；或 (iii) 任何人士因使用指數或其中任何成份或

其所包涵的資料作任何用途而引致之結果，而向權證之任何經紀或權證持有人或任何其他人士作出保證或聲明或擔保，亦不會就指數提供或默示任何保證、聲明或擔保。指數編製人可隨時更改或修改計算及編製指數及其任何有關程式、成份股份及系數之過程及基準，而無須作出通知。於法律容許的範圍內，指數編製人或恒生資訊服務不會因（i）本公司就權證引用及/或參考指數；或（ii）指數編製人在計算指數時的任何失準、遺漏、失誤或錯誤；或（iii）與計算指數有關並由任何其他人士提供的資料的任何失準、遺漏、失誤、錯誤或不完整；或（iv）任何經紀、權證持有人或任何其他處置權證的人士，因上述原因而直接或間接蒙受的任何經濟或其他損失承擔任何責任。任何經紀、持有人或任何其他處置權證的人士，不得因有關權證，以任何形式向指數編製人及/或恒生資訊服務進行索償、法律行動或法律訴訟。任何經紀、持有人或任何其他處置權證的人士，須完全了解此免責聲明，並且不能依賴指數編製人及恒生資訊服務。為免產生疑問，本免責聲明並不會於任何經紀、持有人或任何其他人士與指數編製人及/或恒生資訊服務之間構成任何合約或準合約關係，而亦不應視作已構成該等合約關係。

2014年7月11日