

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。

此乃衍生工具產品或涉及衍生工具的結構性產品。除非閣下完全明白及願意承擔相關的風險，否則不應投資於此產品。閣下務請留意，權證的價格可急升亦可急跌，閣下的投資可能會蒙受全盤損失。閣下務須完全了解權證的潛在風險及回報，並須自行決定權證是否適合閣下投資。如有需要，閣下應徵詢顧問意見。



由

香港上海滙豐銀行有限公司

(The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited)

(根據香港公司條例於香港註冊成立之有限公司)

發行

無抵押結構性產品

權證

公佈

本公司有意發行下文詳述的權證（「權證」）。

證券代號	13405	13406
股份	該公司現已發行普通H股	該公司現已發行普通股
該公司	中國工商銀行股份有限公司	香港交易及結算所有限公司
形式	歐式	歐式
種類	認購	認購
結算方式	現金結算	現金結算
發行量	80,000,000 份權證	40,000,000 份權證
發行價	每份權證 0.26 港元	每份權證 0.90 港元
推出日期(所有系列)	二零一六年九月十五日	
發行日期(所有系列)	二零一六年九月二十二日	
屆滿日期	二零一七年七月三十一日	二零一七年三月三十一日
買賣單位	1,000 份權證	1,000 份權證
權利	一股股份	一股股份
每份權利權證數目	一份權證	十份權證
行使價	5.08 港元	233.88 港元
引伸波幅 ⁽¹⁾	25.86%	34.71%

證券代號	13405	13406
槓桿比率 ⁽¹⁾	18.46 倍	22.14 倍
實際槓桿比率 ⁽¹⁾	6.24 倍	5.65 倍
溢價 ⁽¹⁾	11.25%	21.87%
流通量提供者	滙豐證券經紀(亞洲) 有限公司 (經紀編號: 9727) 香港皇后大道中1號 滙豐總行大廈 17及18樓 電話: (852) 2822 1849	滙豐證券經紀(亞洲) 有限公司 (經紀編號: 9730) 香港皇后大道中1號 滙豐總行大廈 17及18樓 電話: (852) 2822 1849

⁽¹⁾ 引伸波幅、槓桿比率、實際槓桿比率及溢價未必可與其他衍生權證發行機構提供的類似資料作比較，因為每間發行機構可能採用不同的計價模式。

本公司如何計算現金結算金額？

權證以記名形式發行，並只可以有關買賣單位行使。

如於屆滿日期的現金結算金額大於零，權證將會自動行使。

每一手買賣單位將賦予閣下權利，可從本公司收取以港元計算的現金結算金額（減任何行使費用），金額相等於：

就一系列認購證而言：

$$\frac{\text{權利} \times (\text{平均價}^{(2)} - \text{行使價}) \times \text{一手買賣單位}}{\text{每份權利權證數目}}$$

就一系列認沽證而言：

$$\frac{\text{權利} \times (\text{行使價} - \text{平均價}^{(2)}) \times \text{一手買賣單位}}{\text{每份權利權證數目}}$$

惟如現金結算金額為負數，則被視為零。

⁽²⁾ 「平均價」指每一股份於緊接屆滿日期前五個營業日（即香港聯交所預定開市買賣及銀行於香港之營業日（不包括星期六））各日收市價（取自聯交所每日報價表）之算術平均數，有關收市價可作出任何所需調整以反映細則6項下擬進行的任何事項如資本化、供股、分派或類似事宜。

閣下可從何處獲取進一步資料？

本公司於二零一六年四月二十日刊發的基本上市文件（「基本上市文件」）及日期為二零一六年八月二十二日的基本上市文件的增編連同任何額外增編或續編文件、日期將為二零一六年九月二十二日的補充上市文件，與本公司最近期可從公開途徑得到的年報及中期報告，連同該等文件的中文譯本，於一般辦公時間在本公司辦事處（現時地址為香港皇后大道中1號滙豐總行大廈）可供查閱。有關本公司的資料，亦可於本公司所屬集團公司的網站 (www.hsbc.com) 瀏覽。

流通量提供者將如何提供報價？

流通量提供者將會就買入及賣出報價要求作出回應，從而提供流通量。報價可致電索取。

其他資料

權證構成我們而非任何其他人士的一般無抵押合約責任，倘若我們清盤，各權證與我們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，閣下是倚賴我們的信譽，而根據權證，閣下對發行掛鈎股份的公司或任何其他人士並無任何權利。倘若我們無力償債或未能履行我們於權證項下的責任，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)。

本公司將向聯交所申請批准權證在聯交所上市及買賣。預期權證將於二零一六年九月二十三日開始買賣。

本公司為受香港金融管理局規管的持牌銀行，並為根據香港證券及期貨條例(第571章)註冊的機構。

本公司的長期債務信貸評級獲標普全球評級評為AA-級(穩定評級展望)及獲穆迪投資者服務有限公司評為Aa2級(負面評級展望)。

香港上海滙豐銀行有限公司
二零一六年九月十五日