

## 剩餘價值之估值公佈

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，並明確地表示概不就因本公佈全部或任何部分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。

## 無抵押結構性產品



歐式（現金結算）R類可贖回牛／熊證  
（「牛熊證」）  
之剩餘價值的估值通知

發行人

CREDIT SUISSE AG  
（於瑞士註冊成立之有限責任公司）

保薦人／經辦人  
CREDIT SUISSE (HONG KONG) LIMITED

本公佈並無定義的詞語具有牛熊證的一般細則及產品細則（統稱「**細則**」）所定義者的相同涵義。

Credit Suisse AG（「**發行人**」）謹此宣佈，根據細則，有關下表所述之牛熊證就聯交所開市前時段或持續交易時段或收市競價時段（視乎情況而定）於下表註明的時間（「**強制贖回事件時間**」）及日期（「**強制贖回事件日期**」）發生強制贖回事件（「**強制贖回事件**」）後，牛熊證的剩餘價值已釐定如下：

證券代號	類別	強制贖回事件時間	強制贖回事件日期	相關資產	發行額 (份牛熊證)	每份權利之牛熊證數目	權利	買賣單位 (份牛熊證)	行使價 (港元)	最高/最低交易價 (港元)	每手買賣單位的 剩餘價值 (港元)
50189	牛證	14:49:17	2021年7月27日	吉利汽車控股有限公司	100,000,000	50	1.00 股股份	5,000	22.50	21.55	0.0000
50198	牛證	15:13:58	2021年7月27日	長城汽車股份有限公司	60,000,000	50	1.00 股股份	2,500	29.20	28.90	0.0000
50221	牛證	13:33:49	2021年7月27日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	211.00	196.00	0.0000
50223	牛證	14:56:43	2021年7月27日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	201.00	196.00	0.0000
50225	牛證	13:16:50	2021年7月27日	微盟集團	50,000,000	10	1.00 股股份	10,000	8.28	8.20	0.0000
50368	牛證	15:19:16	2021年7月27日	友邦保險控股有限公司	70,000,000	100	1.00 股股份	2,000	88.28	85.50	0.0000
50387	牛證	15:46:51	2021年7月27日	匯豐控股有限公司	100,000,000	100	1.00 股股份	4,000	41.88	42.60	28.8000
50398	牛證	14:35:54	2021年7月27日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	206.00	196.00	0.0000
50947	牛證	14:34:48	2021年7月27日	京東集團股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	2,500	247.00	238.20	0.0000
50948	牛證	15:19:37	2021年7月27日	京東集團股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	2,500	237.00	238.20	6.0000
52660	牛證	15:18:59	2021年7月27日	吉利汽車控股有限公司	100,000,000	50	1.00 股股份	5,000	21.50	21.55	5.0000
52670	牛證	14:20:33	2021年7月27日	思摩爾國際控股有限公司	50,000,000	100	1.00 股股份	10,000	28.88	31.20	232.0000
53726	牛證	15:09:27	2021年7月27日	信義光能控股有限公司	40,000,000	50	1.00 股股份	10,000	13.90	13.30	0.0000
54602	牛證	15:26:09	2021年7月27日	銀河娛樂集團有限公司	80,000,000	100	1.00 股股份	10,000	51.08	51.75	67.0000

證券代號	類別	強制贖回事件時間	強制贖回事件日期	相關資產	發行額 (份牛熊證)	每份權利之牛熊證數目	權利	買賣單位 (份牛熊證)	行使價 (港元)	最高/最低交易價 (港元)	每手買賣單位的 剩餘價值 (港元)
54636	牛證	15:06:32	2021年7月27日	友邦保險控股有限公司	70,000,000	100	1.00 股股份	2,000	89.40	85.50	0.0000
56966	牛證	15:19:15	2021年7月27日	小米集團	100,000,000	50	1.00 股股份	10,000	23.60	23.70	20.0000
57015	牛證	15:14:54	2021年7月27日	中國生物製藥有限公司	40,000,000	10	1.00 股股份	10,000	5.88	6.20	320.0000
59546	牛證	15:18:48	2021年7月27日	中國平安保險(集團)股份有限公司	100,000,000	100	1.00 股股份	5,000	64.40	64.50	5.0000
60383	牛證	13:00:03	2021年7月27日	美團	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	207.00	193.40	0.0000
60879	牛證	15:10:01	2021年7月27日	小米集團	50,000,000	10	1.00 股股份	2,000	24.10	23.70	0.0000
60943	牛證	13:33:31	2021年7月27日	美團	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	197.00	193.40	0.0000
61800	牛證	15:27:47	2021年7月27日	藥明生物技術有限公司	50,000,000	100	1.00 股股份	5,000	101.88	103.60	86.0000
61804	牛證	13:40:37	2021年7月27日	小米集團	100,000,000	50	1.00 股股份	10,000	24.60	23.70	0.0000
62921	牛證	13:13:07	2021年7月27日	美團	50,000,000	100	1.00 股股份	10,000	202.00	193.40	0.0000
62941	牛證	15:10:54	2021年7月27日	阿里巴巴集團控股有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	176.00	174.50	0.0000
63239	牛證	13:05:29	2021年7月27日	香港交易及結算所有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	476.00	451.00	0.0000
63243	牛證	14:47:29	2021年7月27日	阿里巴巴集團控股有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	178.88	174.50	0.0000
63244	牛證	13:47:56	2021年7月27日	香港交易及結算所有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	466.00	451.00	0.0000
64143	牛證	14:52:03	2021年7月27日	騰訊控股有限公司	100,000,000	500	1.00	5,000	447.20	426.00	0.0000

證券代號	類別	強制贖回事件時間	強制贖回事件日期	相關資產	發行額 (份牛熊證)	每份權利之牛熊證數目	股股份 權利	買賣單位 (份牛熊證)	行使價 (港元)	最高/最低交易價 (港元)	每手買賣單位的 剩餘價值 (港元)
64172	牛證	15:02:40	2021年7月27日	中國人壽保險股份有限公司	100,000,000	50	1.00 股股份	5,000	12.40	12.56	16.0000
64186	牛證	13:47:56	2021年7月27日	阿里巴巴集團控股有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	179.00	174.50	0.0000
65186	牛證	15:11:28	2021年7月27日	快手科技	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	105.00	105.00	0.0000
65276	牛證	15:19:30	2021年7月27日	阿里巴巴集團控股有限公司	50,000,000	100	1.00 股股份	10,000	173.00	174.50	150.0000
65786	牛證	14:20:01	2021年7月27日	藥明生物技術有限公司	50,000,000	100	1.00 股股份	5,000	106.88	103.60	0.0000
68226	牛證	15:19:30	2021年7月27日	中國移動有限公司	100,000,000	100	1.00 股股份	5,000	46.88	47.00	6.0000
69161	牛證	15:19:07	2021年7月27日	微盟集團	80,000,000	50	1.00 股股份	5,000	7.78	8.20	42.0000
69345	牛證	15:18:49	2021年7月27日	藥明生物技術有限公司	50,000,000	100	1.00 股股份	5,000	103.00	103.60	30.0000
69626	牛證	13:24:25	2021年7月27日	銀河娛樂集團有限公司	80,000,000	100	1.00 股股份	10,000	53.08	51.75	0.0000
69699	牛證	15:12:43	2021年7月27日	吉利汽車控股有限公司	100,000,000	50	1.00 股股份	5,000	22.00	21.55	0.0000
69750	牛證	14:19:51	2021年7月27日	中國海洋石油有限公司	80,000,000	10	1.00 股股份	10,000	7.40	7.62	220.0000
69942	牛證	15:16:06	2021年7月27日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	196.00	196.00	0.0000

就牛證的每手買賣單位而言，發行人根據以下算式計算剩餘價值的港元金額：

$$\frac{\text{權利} \times (\text{最低交易價} - \text{行使價}) \times \text{一手買賣單位}}{\text{每份權利之牛熊證數目}}$$

就熊證的每手買賣單位而言，發行人根據以下算式計算剩餘價值的港元金額：

$$\frac{\text{權利} \times (\text{行使價} - \text{最高交易價}) \times \text{一手買賣單位}}{\text{每份權利之牛熊證數目}}$$

如無發生交收中斷事件，所有持有人將不遲於2021年8月2日（即強制贖回事件估值期結束後第三個中央結算系統交收日）收取剩餘價值（扣除任何行使費用）（如有）。

**Credit Suisse AG**

2021年7月28日