

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)
50661	熊證	09:20:18	2021年8月16日	招商銀行股份有限公司	80,000,000	100	1.00 股股份	5,000	66.80	66.80	0.0000
51116	牛證	10:30:01	2021年8月16日	快手科技	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	75.00	73.85	0.0000
52259	牛證	10:37:35	2021年8月16日	中芯國際集成電路製造有限公司	50,000,000	50	1.00 股股份	2,500	22.88	23.65	38.5000
53460	牛證	09:39:31	2021年8月16日	小米集團	100,000,000	50	1.00 股股份	10,000	24.60	24.80	40.0000
54206	牛證	10:20:27	2021年8月16日	香港交易及結算所有限公司	50,000,000	100	1.00 股股份	10,000	488.00	485.40	0.0000
54210	牛證	10:02:41	2021年8月16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	179.60	6.0000
55029	牛證	10:40:57	2021年8月16日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	251.00	251.00	0.0000
56129	牛證	10:12:33	2021年8月16日	騰訊控股有限公司	50,000,000	100	1.00 股股份	10,000	453.20	449.00	0.0000
56396	牛證	10:19:29	2021年8月16日	騰訊控股有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	449.08	449.00	0.0000
56653	牛證	09:55:00	2021年8月16日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	256.00	251.00	0.0000
56659	牛證	10:17:23	2021年8月16日	騰訊控股有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	451.08	449.00	0.0000
56673	牛證	10:14:04	2021年8月16日	美團	50,000,000	100	1.00 股股份	10,000	221.88	217.00	0.0000
56737	熊證	09:44:43	2021年8月16日	中國移動有限公司	100,000,000	100	1.00 股股份	5,000	53.88	52.95	46.5000
56923	牛證	09:35:58	2021年8月16日	舜宇光學科技(集團)有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	208.00	206.20	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	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)
56942	牛證	10:37:39	2021年8月16日	吉利汽車控股有限公司	100,000,000	50	1.00 股股份	5,000	26.80	26.30	0.0000
56947	牛證	09:32:06	2021年8月16日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	264.00	251.00	0.0000
56948	牛證	10:23:44	2021年8月16日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	254.00	251.00	0.0000
56955	牛證	10:17:59	2021年8月16日	美團	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	218.00	217.00	0.0000
57239	牛證	09:20:18	2021年8月16日	騰訊控股有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	480.20	449.00	0.0000
57241	牛證	09:20:18	2021年8月16日	騰訊控股有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	473.20	449.00	0.0000
57242	牛證	10:02:52	2021年8月16日	騰訊控股有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	456.08	449.00	0.0000
57244	牛證	09:20:18	2021年8月16日	中芯國際集成電路製造有限公司	50,000,000	50	1.00 股股份	2,500	25.00	23.65	0.0000
57245	牛證	09:20:18	2021年8月16日	中芯國際集成電路製造有限公司	50,000,000	50	1.00 股股份	2,500	23.50	23.65	7.5000
57250	牛證	09:32:55	2021年8月16日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	261.00	251.00	0.0000
57252	牛證	09:20:18	2021年8月16日	美團	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	233.00	217.00	0.0000
57253	牛證	10:09:10	2021年8月16日	美團	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	225.00	217.00	0.0000
57254	牛證	09:20:18	2021年8月16日	阿里巴巴集團控股有限公司	50,000,000	100	1.00 股股份	10,000	186.00	179.60	0.0000
57257	牛證	09:43:52	2021年8月16日	信義光能控股有限公司	80,000,000	50	1.00 股股份	10,000	14.90	14.90	0.0000
57259	牛證	09:20:18	2021年8月16日	吉利汽車控股有限公司	100,000,000	50	1.00	5,000	27.80	26.30	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	權利 股股份	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)
57260	牛證	11:14:16	2021年8月16日	吉利汽車控股有限公司	100,000,000	50	1.00 股股份	5,000	26.50	26.30	0.0000
57261	牛證	09:20:18	2021年8月16日	香港交易及結算所有限公司	50,000,000	100	1.00 股股份	10,000	515.00	485.40	0.0000
57267	牛證	09:20:18	2021年8月16日	小米集團	100,000,000	50	1.00 股股份	10,000	26.60	24.80	0.0000
57268	牛證	09:57:02	2021年8月16日	中遠海運控股股份有限公司	100,000,000	50	1.00 股股份	2,500	13.38	13.80	21.0000
57274	牛證	09:36:56	2021年8月16日	招商銀行股份有限公司	80,000,000	100	1.00 股股份	5,000	63.08	63.45	18.5000
57283	牛證	10:19:51	2021年8月16日	京東集團股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	2,500	265.00	262.00	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19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8月16日