

免責聲明

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司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，概不對因公佈全部或任何部份內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。

剩餘價值的估值公佈

甲部 - 一般資料

發行人	瑞士銀行
擔保人(如適用)	
相關資產種類	本地指數
強制贖回事件發生日期	2023年12月11日
剩餘價值付款日期	不遲於 2023年12月14日
公佈狀態	新公佈

乙部 - 牛熊證資料

證券代號	類別	強制贖回事件發生時間	相關資產	除數	指數貨幣金額 港元	買賣單位	行使水平	最高/最低指數水平	每份牛熊證的剩餘價值 港元	每個買賣單位的剩餘價值 港元
55810	牛證	09:21:12	恒生指數	10,000	1.00	10,000	16,050.0	15,972.31	0	0
62318	牛證	09:21:12	恒生指數	10,000	1.00	10,000	16,088.0	15,972.31	0	0
62468	牛證	09:21:12	恒生指數	10,000	1.00	10,000	16,363.0	15,972.31	0	0
62469	牛證	09:21:12	恒生指數	10,000	1.00	10,000	16,250.0	15,972.31	0	0
62476	牛證	09:21:12	恒生指數	10,000	1.00	10,000	16,138.0	15,972.31	0	0
62447	牛證	09:30:06	恒生科技指數	5,000	1.00	10,000	3,550.0	3,603.52	0.010704	107.04
62482	牛證	09:30:44	恒生指數	10,000	1.00	10,000	16,028.0	15,972.31	0	0
53462	牛證	09:30:54	恒生中國企業指數	10,000	1.00	10,000	5,400.0	5,443.6	0.00436	43.6

證券代號	類別	強制贖回事件發生時間	相關資產	除數	指數貨幣金額 港元	買賣單位	行使水平	最高/最低指數水平	每份牛熊證的剩餘價值 港元	每個買賣單位的剩餘價值 港元
52915	牛證	09:31:08	恒生指數	10,000	1.00	10,000	16,000.0	15,972.31	0	0
62317	牛證	10:18:02	恒生指數	10,000	1.00	10,000	15,978.0	15,972.31	0	0
55664	牛證	10:30:44	恒生指數	10,000	1.00	10,000	15,950.0	15,972.31	0.002231	22.31
55930	牛證	10:56:16	恒生指數	20,000	1.00	10,000	15,900.0	15,972.31	0.0036155	36.155
65556	牛證	10:56:16	恒生指數	10,000	1.00	10,000	15,900.0	15,972.31	0.007231	72.31
61815	牛證	10:58:24	恒生指數	10,000	1.00	10,000	15,888.0	15,972.31	0.008431	84.31

丙部 - 計算公式

發行人會根據下列公式計算釐定每個買賣單位的剩餘價值:

倘為指數牛證系列:

$$\frac{(\text{最低指數水平} - \text{行使水平}) \times \text{一個買賣單位} \times \text{指數貨幣金額}}{\text{除數}}$$

倘為指數熊證系列:

$$\frac{(\text{行使水平} - \text{最高指數水平}) \times \text{一個買賣單位} \times \text{指數貨幣金額}}{\text{除數}}$$

丁部 - 補充資料

不適用

日期: 2023年12月11日