

## 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)
50926	熊證	09:20:05	2021年8月2日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	252.00	260.20	0.0000
50928	熊證	09:31:50	2021年8月2日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	259.00	260.20	0.0000
51121	熊證	09:20:05	2021年8月2日	香港交易及結算所有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	510.00	518.50	0.0000
51129	牛證	09:48:24	2021年8月2日	騰訊控股有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	457.20	459.20	20.0000
52266	牛證	09:48:18	2021年8月2日	騰訊控股有限公司	50,000,000	100	1.00 股股份	10,000	457.58	459.20	162.0000
52888	熊證	09:51:36	2021年8月2日	匯豐控股有限公司	100,000,000	100	1.00 股股份	4,000	44.88	45.15	0.0000
52895	熊證	09:20:05	2021年8月2日	阿里健康信息技術有限公司	40,000,000	10	1.00 股股份	2,000	12.48	12.00	96.0000
52899	熊證	09:20:05	2021年8月2日	香港交易及結算所有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	502.00	518.50	0.0000
52904	熊證	09:20:05	2021年8月2日	信義光能控股有限公司	40,000,000	50	1.00 股股份	10,000	15.88	16.50	0.0000
52906	牛證	09:30:46	2021年8月2日	快手科技	50,000,000	100	1.00 股股份	10,000	105.00	105.00	0.0000
52911	熊證	09:20:05	2021年8月2日	比亞迪股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	25,000	222.00	260.20	0.0000
52921	熊證	09:37:29	2021年8月2日	舜宇光學科技(集團)有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	242.00	242.00	0.0000
52924	熊證	09:20:05	2021年8月2日	京東集團股份有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	2,500	271.00	279.20	0.0000
52980	熊證	09:20:05	2021年8月2日	騰訊控股有限公司	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	470.80	478.80	0.0000
52985	熊證	09:30:00	2021年8月2日	美團	100,000,000	500	1.00 股股份	5,000	221.00	219.60	14.0000
58900	牛證	10:08:28	2021年8月2日	中國工商銀行股份有限公司	100,000,000	10	1.00 股股份	10,000	4.18	4.27	90.0000
65273	熊證	09:32:15	2021年8月2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	29.00	28.95	2.5000
69189	熊證	11:12:03	2021年8月2日	匯豐控股有限公司	100,000,000	100	1.00 股股份	4,000	46.00	45.15	34.0000

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5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2日