

有关汇丰代客境外理财计划-沃达丰 4.375% 2028/5/30 (美元) 项下海外债

券的现金回购要约之通知

尊敬的客户：

您好！

汇丰代客境外理财计划-沃达丰 4.375% 2028/5/30 (美元) (产品代码: IPOB3023VG, ISIN US92857WBK53) 项下境外债券发行人发起现金回购要约邀请。该回购要约邀请的主要内容简述如下：

	早鸟回购申请	非早鸟回购申请
回购对价 (以 1000 美元 名义金额计算)	早鸟回购奖励：每 1,000 美元票面奖励 50 美元。 根据美国国债 4.375% 2027/7/15 于 2024 年 8 月 12 日上午 10 时 (美国纽约时间) 的参考收益率上浮 30 基点为折现率计算得出 (已包含“早鸟回购奖励”)。文末附具体计算公式，以该公式为准。	根据美国国债 4.375% 2027/7/15 于 2024 年 8 月 12 日上午 10 时 (美国纽约时间) 的参考收益率上浮 30 基点为折现率计算得出 (文末附具体计算公式，以该公式为准)，再扣除“早鸟回购奖励”。
回购支付金额	最终回购对价/1000*最终回购金额+自上一付息日 (含) 到回购清算日 (不含) 的应计票息-银行收取的相应服务费	
回购清算日	预计 2024 年 8 月 14 日 (美国纽约时间)	预计 2024 年 8 月 28 日 (美国纽约时间)
向我行提交回购 申请截止日期	2024 年 8 月 6 日下午 15:30 (北京时间)	2024 年 8 月 21 日下午 15:30 (北京时间)

请您于上述载明的反馈截止日期前向您的客户经理反馈您参与回购的申请及申请金额，若我行在反馈截止日期前均未收到您的申请，则表示不参加本次回购。

请您注意：

- 参与回购的本金金额必须为以**万美元**为单位，可全部或部分参与回购，如果是部分参加回购，需要保证未参与回购的剩余名义金额要高于本产品最低赎回名义金额 2 万美元
- 发行人设置了回购金额上限，若早鸟回购期间的回购申请已经达到其回购金额上限，则

不再接受非早鸟回购。若早鸟回购期间的回购申请已经超出其回购金额上限，发行人则会按照比例接受回购申请。

- **回购申请是否会被接受受制于相关条件，您提出的回购申请是否会被接受（包括全部或部分）、最终回购金额上限的确定、最终回购对价的确定、最终回购金额支付，皆取决于境外发行人的最终确认。我行会在收到托管行的通知后向您同步最新情况。**
- 市场上该类债券的流通量或因回购而减少，可能会对赎回价有不利影响或使赎回价更波动，海外债券流动性与市场上留存此类债券的数量及其他因素有关。
- 我行提供以上信息并非也不应被视为关于投资、持有或赎回任何产品的建议。请您根据您的个人情况考虑和自行决定是否参与回购。

如您希望了解进一步的详情，可向我行索取我行从境外债券发行人处获得的 <Offer to Purchase for Cash>，与本次回购相关的法律条款均以该文件为准。如您需要参与回购，请务必在上述载明的时间内联系您的客户经理进行办理。

敬请知悉。

汇丰银行（中国）有限公司

2024年8月2日

附最终回购对价计算公式：

YLD: 美国国债 4.375% 2027/7/15 于 2024 年 8 月 12 日上午 10 时 (美国纽约时间) 的参考收益率上浮 30 基点, 以百分比表示。

CPN: 原债券的票息率。

N: 原债券从早鸟回购清算日 (不含) 到到期日 (含) 中间应支付的票息次数 (每半年支付)。

P: 从早鸟回购清算日前最近一次的票息支付日 (含) 到早鸟回购清算日 (不含) 之间的天数。用 30/360 的天数计算方式计算。

/: 除号。

Exp: 指数符号。

N

Σ

k=1 : 求和公式。K 指的是从 1 (含) 到 N (含)。

回购对价 (以 1000 美元名义金额计算) 为：

$$\left[\frac{\$1,000}{(1 + YLD/2) \exp(N - P/180)} \right] + \sum_{k=1}^N \left[\frac{\$1,000 (CPN/2)}{(1 + YLD/2) \exp(k - P/180)} \right] - \$1,000 (CPN/2)(P/180)$$