

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，並明確表示概不就因本公佈全部或任何部份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

由

BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE B.V.

（於荷蘭註冊成立，其法定所在地位於阿姆斯特丹）

發行及由

法國巴黎銀行

（於法國註冊成立）

無條件及不可撤銷地擔保的

**有關恒生指數 250,000,000 份 2017 年歐式（現金結算）R 類可贖回熊證
（「牛熊證」）之估量剩餘價值通知
（證券代號：60758）**

保薦人

法國巴黎證券（亞洲）有限公司

公佈

BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE B.V.（「**發行人**」）現通知如下：根據牛熊證的條款及細則（「**細則**」），牛熊證於 2017 年 02 月 20 日 10 時 21 分 42 秒發生強制贖回事件（「**強制贖回事件**」）後，牛熊證的剩餘價值已釐定為每個買賣單位 197.70 港元（每個買賣單位為 10,000 份牛熊證）。

剩餘價值是發行人按照以下算式所釐定的數值：

每個買賣單位的
剩餘價值 =
$$\frac{(\text{行使水平} - \text{最高指數水平}) \times \text{指數貨幣額} \times \text{一個買賣單位}}{\text{除數}}$$

其中：

- (a) 「**指數貨幣額**」為港元 1.00
- (b) 「**除數**」為 10,000
- (c) 「**行使水平**」為 24,400.00；而
- (d) 「**最高指數水平**」指指數於強制贖回事件估值期內最高現貨水平，即 24,202.34

除非發生交收中斷事件，所有合資格的牛熊證持有人將於 2017 年 02 月 23 日（即強制贖回事件估值日後三個中央結算系統交收日）獲得剩餘價值(如有)(扣減任何行使費用)。

本公佈沒有定義的用語具有細則所賦予的涵義。

香港，2017 年 02 月 20 日