

## 有关汇丰代客境外理财计划项下两只沃达丰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 4.125% 2025/5/30 (美元) (产品代码：IPOB3011VG, ISIN US92857WBJ80) 及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：

	汇丰代客境外理财计划 - 沃达丰 4.125% 2025/5/30 (美元) (产品代码: IPOB3011VG, ISIN US92857WBJ80)	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)
回购对价 (以 1000 美元 名义金额计算)	固定价格为 1000 美元	根据美国国债4.25% 2028/1/15 于 2025 年 2 月 11 日上午 11 时 (美国纽约时 间) 的参考收益率上浮 20 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。
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 2025 年 2 月 14 日 (美国纽约时间)	
向我行提交回购 申请截止日期	2025 年 2 月 10 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至少要有 2 万美元
- **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。

在现金回购要约发布的同时，境外发行人也将发布关于在要约中未被购买的任何固定价格票据的赎回通知（2025 年票据赎回），赎回价格等于以下两者中较大者：（1）该票据的面值 100%加上逾期未支付的利息；（2）该票据剩余预定本金和利息支付的现值总和（不包括在赎回当天累计的任何部分利息）折现至赎回日，按半年度计算（假设 360 天的年度由十二个 30 天的月份组成），折现率为（i）调整后的国债利率（如 2018 年 5 月 23 日与固定价格票据相关的招股说明书补充中所定义）加上（ii）20 个基点，加上截至赎回日期的预期未支付的利息。最终赎回条款，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。

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。

附最终回购对价计算公式:

YLD: 美国国债 4.25% 2028/1/15 于 2025 年 2 月 11 日上午 11 时 (美国纽约时间) 的参考收益率上浮 20 基点, 以百分比表示。

CPN: 原债券的票息率。

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

S: 从回购清算日前最近一次的票息支付日 (含) 到回购清算日 (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:

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

敬请知悉。

汇丰银行 (中国) 有限公司

2025 年 2 月 7 日