

**结构性投资帐户2015年第01期
挂钩标的的价格调整通知及产品到期报告**

一、 挂钩标的的调整通知


花旗银行(中国)有限公司结构性投资帐户 2015 年第 01 期（以下称“本产品”）的挂钩标的“携程国际有限公司上市于纳斯达克证券交易所的股票”（以下称“携程国际有限公司股票”）的存托股与普通股的兑换比率由原来的 4:1 调整为 8:1，并于 2015 年 12 月 1 日生效。由此，股票价格将根据调整系数 0.5 进行调整。该挂钩标的的调整信息具体如下：

挂钩标的-携程国际有限公司股票 (CTRP UW Equity)	调整前	调整后
初始水平	USD 48.96	USD 24.48


- 有关调整事件的风险提示请详见本产品风险揭示书“股票调整事件风险”及“潜在调整事件风险”的相关内容。

由于此次产品在 2015 年 4 月 6 日时已发生触发事件，则到期投资收益率为 3.5%，本次调整不影响产品到期投资收益率。

二、 产品到期表现

 到期投资收益率：**3.50%**（即简单年化到期投资收益率**3.50%**）

 本金及到期投资收益到账日：2016年01月28日

 产品表现：

- 由于触发事件于2015年04月06日发生，则
- 到期投资收益率=触发收益率=3.5% (即简单年化投资收益率3.5%)
- 触发事件：在观测期内的任一交易日挂钩标的的表现大于触发水平123%

 挂钩标的经调整后的参考价格走势

挂钩标的	初始价格 2015年01月28日	触发事件	触发事件发生时价格 2015年04月06日
携程国际有限公司股票 (CTRP UW Equity)	USD 24.48	USD24.48x123%= USD30.11	USD 30.58



(数据来源：彭博资讯，2016年01月22日)

三、 到期投资收益计算方式

- ✚ 到期投资收益 = 认购金额 × 到期投资收益率
- ✚ 如果观测期内触发事件没有发生：到期投资收益率 = (挂钩标的期末价格 / 挂钩标的初始价格 - 1) × 100%，最低不低于0.50% (即简单年化投资收益率0.50%)；
- ✚ 如果观测期内触发事件发生：到期投资收益率 = 触发收益率
- ✚ 触发事件：在观测期内的任一交易日挂钩标的表现高于触发水平123.00%
- ✚ 挂钩标的期末表现 = (挂钩标的期末价格 / 挂钩标的初始价格) × 100%
- ✚ 挂钩标的初始价格：期初评价日由交易所公布的挂钩标的的正式收盘价
- ✚ 挂钩标的期末价格：期末评价日由交易所公布的挂钩标的的正式收盘价

免责声明

本产品到期表现报告为一般信息发布，仅供阁下个人参阅。虽然本报告中有关挂钩标的表现、相关内容陈述均取自于花旗银行(中国)有限公司认为的可靠来源，但花旗银行(中国)有限公司不保证其准确性和完整性。该等信息可能不完整或已精简。花旗银行(中国)有限公司不为本报告被错误引述或信息遗漏而造成的任何损失负责。

花旗银行(中国)有限公司

二〇一六年一月