

## 证券及指数产品注解

如本证券及指数产品注解（以下称“本注解”）在投资产品条款说明书中被引用作为附件，则其构成投资产品条款说明书的一部分。如本注解与投资产品条款说明书有任何不一致，以投资产品条款说明书为准。本注解中的所有定义并非均与投资产品条款说明书规定的投资产品相关。

“调整”指，潜在调整事件及指数调整事件。银行将在合理可行的最短时间内通知客户某一调整事件的发生，但银行未能通知客户不影响该调整事件的有效发生以及该调整事件对投资产品的效力。

“关联单位”指，就任何人士而言，(i) 任何受其直接或间接控制的实体，(ii) 任何直接或间接控制该人士的实体，以及 (iii) 任何与该人士共处于同一直接或间接控制下的实体；为此目的，“控制”任何实体或人士是指拥有该实体或人士的多数投票权。

“所有交易所”指，就某一证券或指数而言，(i) 任一交易所或报价系统，只要该交易所或报价系统的交易对与该证券或指数有关的期货或期权合约交易市场产生重大影响（由银行认定）；(ii) 前述交易所或报价系统的继承者或可临时进行与该证券或指数有关的期货或期权合约交易的交易所或报价系统（只要银行认为，就该交易而言，该临时替代交易所或报价系统与原交易所或报价系统相比具有可比的流动性）。

“银行事件”指，(i) 银行对其在相关管辖区域的债务或存款宣布延期偿付或宣布任何暂停、免除、延迟或拒绝支付；(ii) 相关管辖区域的任何政府部门就任何本金、利息或其他银行债务强制要求银行延期偿付，或要求银行暂停、免除、延迟或拒绝支付，或要求银行重新确定还款计划或要求银行获得批准，或限制从银行提取任何存款；(iii) 相关管辖区域的银行支付系统发生系统中断等情形，导致银行不能收取或支付结算货币或替代货币；或(iv) 由于政府部门的任何作为或不作为而产生或导致的银行认为与前述事件具有类似效果的任何情形。

“法律变更”指在投资产品起始日当天或之后，(A) 由于任何适用的法律或法规的施行和变更（包括但不限于任何税法），或(B) 由于法院、法庭或有管辖权的监管机构对于任何适用的法律或法规的解释的颁布及任何变更（包括税务机构采取的任何行动），银行善意地认定：(i) 银行持有、获取或处置与投资产品相关的任何证券、指数成份股或对冲头寸已变为非法，或(ii) 银行履行投资产品项下义务的成本实质性地提高（包括但不限于税费的增加、税项利益的减少或对银行课税情况的其他不利影响）。

“货币事件”指因任何事件的发生或任何情况的存在（包括但不限于因任何政府部门对法律、准则、法规的制定、颁布、执行、批准、解释、适用、变更或修订而引致的任何事件或情况）而普遍造成相关管辖区域的非居民从事以下事项成为不可能、不合法、不实际或该非居民从事以下事项的能力受到实质性地妨碍：(a) 通过通常的合法渠道将结算货币兑换为替代货币，或反之将替代货币兑换为结算货币；或(b) 按照与相关管辖区域居民同等优惠的条件从事货币交易；或(c) 将任何资金(i) 从相关管辖区域内账户转移至相关管辖区域外的账户；或(ii) 在相关管辖区域内账户之间进行转移，除非截止起始日时任何该等限制或条件已经生效并适用于相关管辖区域的非居民。

“退市”指，对任何证券而言，交易所宣布按照交易所的规定，无论任何原因（但合并事件或收购要约除外），该证券在交易所停止（或将停止）上市、交易或公开报价，并且未立即在同一国家或地区（或，如是欧盟内的交易所，则在欧盟的任何成员国）的交易所或报价系统重新上市、重新交易或重新报价。如果在美国的交易所交易的证券未能立即在纽约证券交易所、美国证券交易所、纳斯达克全球精选市场或者纳斯达克全球市场（或者他们各自的继承者）重新上市、重新交易或重新报价，则同样构成“退市”；如果该证券立即在任何该等交易所或者报价系统重新上市、重新交易

或重新报价，该等交易所或者报价系统将被视为该证券的交易所。

**“干扰日”**指，发生下列事件的任何规划交易日：**(a)**有关的交易所或任何相关交易所其常规交易时段未能开放进行交易，或**(b)**发生市场干扰事件；但对于跨交易所指数而言，干扰日为发生下列事件的任何规划交易日：**(i)**指数发起人未能公布指数水平；**(ii)**相关交易所其常规交易时段未能开放进行交易；或**(iii)**发生市场干扰事件。如果不是因为干扰日的发生，该日本应为定价日，银行将在合理可行的最短时间内通知客户该干扰日的发生，但是，银行未能通知客户不影响该干扰日的有效发生以及该干扰日对投资产品的效力。

**“提前收市”**指，有关的交易所（或，对一指数而言，与占该指数 20% 以上权重水平的指数成份股相关的任何交易所）或任何相关交易所任何交易日的收市时间早于规划收市时间，除非该收市时间由该交易所或任何相关交易所在以下两者中的较早时间提前一小时宣布：**(A)**该交易所或相关交易所在交易所营业日常规交易时段的实际收市时间，以及**(B)**交易指令递交至该交易所或相关交易所系统（以供在该交易所营业日的定价时间执行）的截止时间；但对于跨交易所指数而言，提前收市是指，与指数成份股有关的交易所或任何相关交易所任何交易日的收市时间早于规划收市时间，除非该收市时间由该交易所或相关交易所（视情况而定）在以下两者中的较早时间提前一小时宣布：**(i)**该交易所或相关交易所（视情况而定）在交易所营业日常规交易时段的实际收市时间，以及**(ii)**交易指令递交至该交易所或相关交易所系统（以供在该交易所营业日的定价时间执行）的截止时间。

**“证券”**指，在投资产品条款说明书中注明的股票或其他有价证券（**“股票”**），或信托基金单位或代表基金、集合投资计划、汇集投资工具或类似工具所有权的名义单位（**“基金”**）。

**“证券清算系统”**指，惯常用于相关证券交易结算的本地主要清算系统或由银行决定的其他清算系统。

**“证券清算系统营业日”**指，对于证券清算系统而言，该证券清算系统开放运行并可以接受、执行结算指令的任何日期（或，如果不是因为发生结算干扰事件，该证券清算系统本应开放运行并可以接受、执行结算指令的日期）。

**“证券发行人”**指，证券的发行人。

**“交易所”**指，对于任一证券而言，在投资产品条款说明书中注明的与该证券相关的交易所或者报价系统，或者该等交易所或报价系统的继承者或可临时进行该等证券交易的替代交易所或报价系统（只要银行认为，就该证券的交易而言，该临时替代交易所或报价系统与原交易所相比具有可比的流动性）；对于任一指数而言（跨交易所指数除外），指在投资产品条款说明书中注明的与该指数相关的交易所或者报价系统，或者该交易所或报价系统的继承者或可对该指数的指数成份股进行临时交易的替代交易所或报价系统（只要银行认为，就该指数的指数成份股的交易而言，该临时替代交易所或报价系统与原交易所相比具有可比的流动性）；就跨交易所指数而言，对跨交易所指数的任一指数成份股，交易所是指由银行认定的主要进行相关指数成份股交易的交易所或者报价系统，及该交易所或报价系统的继承者或可临时进行指数成份股交易的替代交易所或报价系统（只要银行认为，就该指数成份股的交易而言，该临时替代交易所或报价系统与原交易所相比具有可比的流动性）。

**“交易所营业日”**指，任何规划交易日，在该日每一交易所及每一相关交易所各自的常规交易时段内均开放进行交易，而无论该交易所或相关交易所是否早于其规划收市时间收市；但就跨交易所指数而言，指任何规划交易日，在该日指数发起人公布指数水平且相关交易所在常规交易时段内开

放进行交易，而无论该相关交易所是否早于其规划收市时间收市。

**“交易所干扰”**指，对市场参与者的下述能力造成普遍干扰或损害（由银行认定）的任何事件（提前收市除外）：**(A)**在交易所（或对一个指数而言，占该指数20%以上权重水平的指数成份股所在的交易所）进行证券交易，或取得该证券的市场价值，或**(B)**在任何相关交易所进行与证券或相关指数有关的期货、期权合约交易，或取得该等期货、期权合约的市场价值；但对跨交易所指数而言，交易所干扰是指，对市场参与者的下述能力造成普遍干扰或损害（由银行认定）的任何事件（提前收市除外）：**(i)**对任何指数成份股而言，在交易所对该等指数成份股进行交易或取得其市场价值，或**(ii)**在相关交易所进行与该指数有关的期货、期权合约交易，或取得该等期货、期权合约的市场价值。

**“异常事件”**指，退市、合并事件、收购要约、国有化、无力偿债、无力偿债申请、法律变更、对冲干扰以及异常基金事件。银行将在合理可行的最短时间内通知客户该等异常事件的发生，但银行未能通知客户不影响该等异常事件的有效发生，以及该等异常事件对投资产品的效力。

**“异常基金事件”**指，对于相关的基金而言，发生**(A)**终止；或**(B)**暂停或取消基金文件赋予投资者的要求赎回基金的权利；或**(C)**对相关证券发行人（包括其不时指定的任何继承人）负有主要管理责任的受托人、管理人或类似人士（以下称**“受托人”**）发生清算、破产、无力偿债、解散或停业；或被指定自主或非自主地向相关证券发行人（包括不时指定的任何继承人）提供投资管理或顾问服务的管理人、顾问或类似人士（以下称**“管理人”**）发生清算、破产、无力偿债、解散或停业；或**(D)**对受托人持有的相关证券发行人的全部或大部分产业、财产或资产，在任何适用法律下委派清算人、接收人、管理人、保管人或类似人士；或**(E)**银行确定的与前述事件或情况相类似的任何事件或情况。此处的**“终止”**指，**(i)**相关证券发行人被终止，或受托人或管理人被要求根据基金文件或适用法律终止相关证券发行人，或相关证券发行人的终止程序开始启动；**(ii)**相关证券发行人被认定为未成立或未完善成立，或受托人或管理人承认该证券发行人未成立或未完善成立；**(iii)**相关证券发行人不再授权受托人以自己的名义持有证券发行人名下的财产及履行其在基金文件下的义务；**(iv)**对该等基金或证券发行人具有监管权的任何政府、法律或监管机构取消、暂停或撤销该等基金或相关证券发行人的登记或批准；或**(v)**相关证券发行人、其受托人或管理人的业务活动涉嫌违反适用法律，任何相关政府、法律或监管机构对该等证券发行人、其受托人或管理人进行调查、提起法律程序或诉讼。

**“基金文件”**指，对相关基金而言，信托契约或其他与相关证券发行人成立有关的章程性文件及管辖性文件、认购协议、管理协议及载有与该基金有关的条款及条件的相关证券发行人的其他协议，以及对上述文件的不时修订。

**“定价时间”**指，在投资产品条款说明书中注明的相关定价日的时间，或如无注明，则指相关交易所所在与证券或指数定价有关的相关定价日的规划收市时间（或，如相关交易所早于其规划收市时间收市，则指其常规交易时段的实际收市时间）；但对跨交易所指数而言，定价时间是指，**(A)**为决定是否发生市场干扰事件之目的，**(i)**就任何指数成份股而言，与该指数成份股有关的交易所的规划收市时间，及**(ii)**就该指数的任何期权或期货合约而言，相关交易所的交易结束时间；及**(B)**在所有其他情况下，指数发起人计算并公布该指数官方收市水平的的时间。

**“政府部门”**指，任何法律上或事实上的政府（或其任何机构、部门）、法院、法庭、行政或其他政府机关，或负责管理相关管辖区域金融市场（包括中央银行）的任何其他机构（私有或公有）。

**“对冲头寸”**指，购买、销售、叙作或维持：**(i)**一个或多个与任何相关证券或指数成份股、期权、期货、衍生品或外汇有关的头寸或合约，**(ii)**一笔或多笔有价证券借贷交易，或**(iii)**银行或其关联单位为了单一或组合地对冲投资产品而设的一个或多个其他工具或安排（无论如何描述）。



**“对冲成本”**指，银行按商业上的合理方式善意认定的因解除、终止、清算、调整、获得、替代或重建任何标的的或相关的对冲安排（包括但不限于任何期权，出售或以其他方式实现银行持有并作为该等对冲安排一部分的任何类型的金融工具）而使银行遭受的损失、费用及成本（如有）。

**“对冲干扰”**指，(A)经过商业上的合理努力后，银行不能从事下列行为或从事下列行为不实际，或(B)从事下述行为将使银行的税赋或费用实质性地增加（与起始日的情况相比）：(i)为对冲因叙作投资产品及履行投资产品义务而产生的任何证券或指数价格风险（或任何其他相关风险，包括但不限于货币风险），获得、建立、重建、替代、维持、解除或处置银行认为必要或适当的任何交易或资产；(ii)在对冲头寸的管辖区域（“受影响管辖区域”）内的账户间或从受影响管辖区域内的账户至受影响管辖区域外的账户，自由地实现、收取、获得、汇划或划转与任何交易、资产、对冲头寸或投资产品有关的收益。该等不能或不实际的原因包括但不限于：(1)相关证券发行人限制投资人全部或部分地赎回相关基金或提高该等赎回的费用；或相关证券发行人限制现有或新的投资人对相关基金进行新的或追加投资或提高该等投资的费用；或(2)相关证券发行人对相关基金全部或部分进行强制赎回（以上情形均排除在起始日已存在的任何限制）。

**“对冲干扰事件”**指，(a) 经过商业上的合理努力后，银行不能从事下述行为，或(b)从事下述行为将会使银行的税赋或费用实质性地增加（与起始日的情况相比）：(i)为对冲因叙作投资产品及履行投资产品义务而产生的货币风险（或任何其他相关风险，包括但不限于利率风险），获取、建立、重建、替代、维持、解除或处置银行认为必需的任何交易或资产；或(ii)自由地实现、收回、收取、获得、汇划或划转与该等交易或资产有关的收益。

**“指数”**指，在投资产品条款说明书中注明的每一指数。

**“指数调整事件”**指，指数修正、指数取消或指数干扰，视情况而定。

**“指数取消”**指，由相关指数发起人宣布永久性地取消相关指数，并且不存在继承指数。

**“指数成份股”**指，就任一指数而言，作为不时计算该等指数水平参考依据的股票、有价证券、合约或其他项目（包括其他指数）。

**“指数干扰”**指，在任何相关的定价日，相关的指数发起人未能计算并公布相关的指数。

**“指数修正”**指，相关的指数发起人宣布将对相关指数的计算公式或方法进行重大变更，或以其他方式对相关指数进行重大修正（但因成份股变更、资本化及其他常规事件发生，为维持该指数而对指数计算公式及方法进行修正的除外）。

**“指数发起人”**指，下列公司或实体：(i)负责制定和审核与相关指数有关的规则、程序以及计算与调整方法（如有）；并且(ii)定期在每个规划交易日（直接或通过代理人）宣布相关的指数水平。

**“无力偿债”**指，因发生证券发行人自愿或非自愿的清算、破产、无力偿债、解散或停业，或发生影响证券发行人的任何类似程序，(i)证券发行人的所有股票或基金被要求转让给受托人、清算人或其他类似的官员，或(ii)该证券发行人的股票或基金的持有人在法律上被禁止转让该等股票或基金。

**“无力偿债申请”**指，(i)证券发行人提起法律程序，或在其成立或组建的司法管辖区或其总公司或总部的司法管辖区内，对其拥有主要破产、重整或监管权的监管者、管理者或任何其他类似官员针对其提起或已提起法律程序，或证券发行人同意的某一法律程序，该法律程序的目的在于按任何破产法或无力偿债法律或影响债权人权利的任何其他类似法律寻求无力偿债或破产判决或任何其他救济方法；或(ii)证券发行人或上述监管者、管理者或类似官员提交业务结束或对其进行清算的请求，

或证券发行人同意的关于结束其业务或对其进行清算的请求。但是，如果法律程序或请求由债权人提出或提交而未经证券发行人同意，则不应被视作无力偿债申请。

**“市场干扰事件”**指，发生或存在下述事件：**(A)**银行认定为重大的并发生在相关定价时间前一小时内任何时间的交易干扰，或**(B)**银行认定为重大的并发生在相关定价时间前一小时内任何时间的交易所干扰，或**(C)**提前收市。为决定某一指数在任一时刻是否存在市场干扰事件，若在该时刻就某一指数成份股而言发生了市场干扰事件，则该指数成份股对相关指数水平的贡献度百分比应基于以下两者的比较：**(i)**在该等市场干扰事件发生前的最近时刻，该指数成份股占该指数水平的权重部分，与**(ii)**在该等市场干扰事件发生前的最近时刻，该指数的总体水平。但是，就跨交易所指数而言，市场干扰事件是指：

(x) **(a)**对于任一指数成份股而言，发生或存在下述事件：

(1)就该指数成份股进行主要交易的交易所而言，银行认定为重大的并发生在相关定价时间前一小时内任何时间的交易干扰；

(2)就该指数成份股进行主要交易的交易所而言，银行认定为重大的并发生在相关定价时间前一小时内任何时间的交易所干扰；**或**

(3)提前收市；**以及**

**(b)**发生或存在交易干扰、交易所干扰或提前收市的所有指数成份股的权重累计达到该指数水平的**20%**以上；**或**

(y) 就与该指数相关的期货或期权合约而言，发生或存在下述事件：**(1)**银行认定为重大的并发生在相关定价时间前一小时内任何时间的交易干扰；**(2)**银行认定为重大的并发生在相关定价时间前一小时内任何时间的交易所干扰；**或(3)**提前收市。

就跨交易所指数而言，为决定在任一时刻是否存在市场干扰事件之目的，若在该时刻就某一指数成份股而言发生了市场干扰事件，则该指数成份股对相关指数水平的贡献度百分比应基于以下两者的比较：**(i)**该指数成份股占该指数水平的权重部分，与**(ii)**该指数的总体水平；对于上述两种情形，均使用指数发起人公布的作为市场“公开信息”一部分的正式公布的权重。

**“合并事件”**指，就任一相关证券而言，**(i)**该证券的任何重新分类或变更，而该等重新分类或变更导致将所有已发行的该等证券转移或不可撤销地承诺转移给另一实体或人士；**(ii)**该证券发行人与另一实体或人士进行任何联合、合并、兼并或换股（但如果联合、合并、兼并或换股后，该证券发行人为存续实体，且不导致所有已发行的该等证券的重新分类或变更，则该等事件不构成合并事件）；**(iii)**任何实体或人士要求购买或获得证券发行人**100%**的已发行证券的协议收购要约、公开收购要约、换股要约、请求、建议或其他，并导致转移或不可撤销地承诺转移所有该等证券（由该其他实体或个人控制或拥有的证券除外）；或**(iv)**证券发行人或其附属公司与另一实体进行任何联合、合并、兼并或换股，证券发行人为存续实体且未导致所有已发行的该等证券的重新分类或变更，但却导致在上述事件发生之前的已发行证券（由该其他实体拥有或控制的证券除外）占在上述事件发生之后已发行证券的比例低于**50%**（“反向收购”）。

**“跨交易所指数”**指，其指数成份股在一个以上的交易所进行交易的指数。

**“国有化”**指，证券发行人的全部证券、全部或大部分的资产被国有化、被征收或被要求转让给任何政府机构、机关、实体或其附属机构。

**“国有化事件”**指，政府部门实施的征收、没收、冻结、征用、国有化或其他行为，该行为直接或

间接剥夺了任何相关管辖区域的非居民在相关管辖区域内的任何资产（包括收取款项的权利）。

“潜在调整事件”指，下列任何一种情况：

- (A) 相关股票或相关基金的拆分、合并或重新分类（但导致合并事件的除外），或通过红利、资本化或类似方式，向现行持有人免费派发或分发该股票或基金；
- (B) 向相关股票或相关基金的现行持有人派发、发行或拆分：**(i)** 额外的股票或基金，或**(ii)** 其他股本或有价证券，以使其持有人享有与相关股票或基金的持有人同等或按比例收取股息的权利，及/或取得相关证券发行人清算款项的权利，或**(iii)** 因分拆或其他类似交易，相关证券发行人收购或拥有（直接或间接）的另一发行人的股本或其他有价证券，或**(iv)** 任何类型的其他有价证券、权利、权证或其他资产，而上述交易的支付价款（以现金或其他对价）均低于银行所认定的届时市场价格；
- (C) 由银行认定的特别分红或派发；
- (D) 证券发行人催缴相关股票或基金的未实缴资本；
- (E) 相关股票发行人或其任何附属机构，或相关基金发行人的受托人或管理人（按照基金文件由该基金投资人发起的基金赎回除外）进行的回购，不论回购所用资金来自利润或资本，亦不论是以现金、有价证券或其他方式作为对价；
- (F) 对相关股票而言，针对敌意收购做出的股权计划或安排导致任何股东权利从相关证券发行人的普通股股份或其他股本的股份分派或分离出去的事件；且该等股权计划或安排规定，在发生特定事件时，将优先股、权证、债务票据或股权以银行认定的低于市价的价格进行派发，但由于该等事件而导致的任何调整，应在赎回该等权利时重新调整；或
- (G) 对相关股票或相关基金而言，由银行认定的与前述事件类似的任何事件，或可能对相关股票或相关基金的理论价值有摊薄或集中效应的其他任何事件。

“规划收市时间”指，就某一交易所或相关交易所以及某一规划交易日而言，该交易所或相关交易所在该规划交易日的预定的工作日收市时间，而不考虑收市后或常规交易时段以外的任何其他交易。

“规划交易日”指，每一交易所及每一相关交易所在其各自的常规交易时段预定开放交易的任一天，而就跨交易所指数而言，规划交易日指，指数发起人预定公布指数水平以及相关交易所在其常规交易时段预定开放交易的任一天。

“结算周期”指，相关证券在交易所进行交易后，按照该交易所的规则进行常规清算的证券清算系统营业日的期间。

“结算干扰事件”指，就任一证券而言，银行及客户无法控制的导致相关证券清算系统不能就该证券转让进行清算的事件。

“结算费用”指，银行善意确定的在投资产品下与证券的转让有关的所有费用（包括但不限于任何印花税、证券交易税或本地税），该等费用须由该证券的受让人支付。

“继承指数”指，

- (i) 如果相关指数不是由相关指数发起人计算和公布，而是由银行接受的继承发起人计算和公布，则指由该等继承发起人计算并公布的指数；或
- (ii) 如果相关指数被另一指数替代，且银行认为该等替代指数使用了与该相关指数相同或实质相似的计算公式和方法，则指该等替代指数。

“收购要约”指，由任何实体或人士发出的公开收购要约、协议收购要约、交换要约、请求、建议

---

或其他事件，银行基于在政府性或自律性机构的备案或其认为相关的其他信息，认定上述事件导致该实体或者人士通过股票转换或其他方式，购买、得到或有权得到高于 10%且低于 100%的由证券发行人发行的有投票权的股份。

**“交易干扰”**指，因价格变动超过了有关的交易所或相关交易所允许的限额或其他原因，有关的交易所或相关交易所或其他机构暂停或限制与下列有关的交易：**(A)**在交易所（或，对于一指数而言，在与占该指数 20%以上权重水平的指数成份股相关的任何有关交易所）交易的证券，或**(B)**在有关交易所交易的与证券或相关指数有关的期权或期货合约；但对跨交易所指数而言，交易干扰是指，因价格变动超过了有关的交易所或相关交易所允许的限额或其他原因，有关的交易所或相关交易所或其他机构暂停或限制与下列有关的交易：**(i)**在有关的交易所交易的任一指数成份股；或**(ii)**在相关交易所交易的与该指数相关的期权或期货合约。