

本公佈僅供參考，並不構成買入、購買或認購下述權證的邀請或要約。

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聲明，並明確地表示概不就本公佈全部或任何部分內容所產生或因依賴該等內容而引致之任何損失承擔任何責任。

Macquarie Bank Limited

（根據澳洲法律註冊成立）

發行權證公佈

保薦人

麥格理證券（亞洲）有限公司



權證詳情

本公司擬發行以下權證：

權證	第一系列	第二系列	第二系列
股份代號	6165	6166	6170
發行額	188,000,000	188,000,000	188,000,000
類別	歐式現金結算 認沽權證	歐式現金結算 認沽權證	歐式現金結算 認購權證
指數	恒生中國企業指數	恒生中國企業指數	恒生中國企業指數
買賣單位	10,000 權證	10,000 權證	10,000 權證
每份權證發行價 （港元）	0.251	0.256	0.256
行使價（港元）	8,600.000	9,000.000	9,000.000
指數貨幣金額	1.00 港元	1.00 港元	1.00 港元
推出日	2006 年 11 月 23 日	2006 年 11 月 23 日	2006 年 11 月 23 日
發行日	2006 年 11 月 29 日	2006 年 11 月 29 日	2006 年 11 月 29 日
預期上市日	2006 年 11 月 30 日	2006 年 11 月 30 日	2006 年 11 月 30 日
期滿日	2007 年 5 月 30 日	2007 年 5 月 30 日	2007 年 5 月 30 日
權利	一個指數單位	一個指數單位	一個指數單位
每份權利之權證數目	3,700	4,500	3,600
引伸波幅*	40.00%	40.00%	40.00%
實際槓桿比率*	3.97 倍	3.67 倍	5.02 倍
槓桿比率*	9.27 倍	7.47 倍	9.48 倍
溢價*	10.90%	8.85%	13.57%

*此項數據未必可與其他衍生權證發行機構提供的同類資料互相比較。每間發行機構可能使用不同的計價模型。

於到期時閣下將獲得多少款項？

閣下毋須遞交任何行使通知，權證將於有關期滿日自動行使，屆時 閣下將就每個買賣單位獲得按下列算式計算的港元現金結算金額（如屬正數）：

就一系列認購權證而言：

$$\text{每個買賣單位的現金結算金額} = \frac{(\text{收市水平} - \text{行使水平}) \times \text{指數貨幣金額} \times \text{一個買賣單位}}{\text{每份權利之權證數目}}$$

就一系列認沽權證而言：

$$\text{每個買賣單位的現金結算金額} = \frac{(\text{行使水平} - \text{收市水平}) \times \text{指數貨幣金額} \times \text{一個買賣單位}}{\text{每份權利之權證數目}}$$

「收市水平」指恒生中國企業指數 2007 年 5 月期貨合約的最後交收數目，根據香港期貨交易所股票指數期貨交易規例 012 條及 H 股指數期貨合約合約細則釐定。

權證上市

本公司將向聯交所申請批准權證在聯交所上市及買賣。

如何索取報價？

閣下可致電以下電話號碼索取權證的報價：

流通量提供者： 麥格理證券（亞洲）有限公司
經紀編號： 9589
地址： 香港中環添美道 1 號中信大廈 19 樓
電話號碼： +852 2823 3788

本公司並無就權證與任何經紀訂立任何特別安排。

如何查閱有關文件？

以下文件（「上市文件」）均備有中、英文版本，可於期滿日前在香港中環添美道 1 號中信大廈 19 樓查閱：

- 1 本公司於 2006 年 5 月 30 日刊發的基礎上市文件；
- 2 於 2006 年 11 月 22 日刊發之增編；及
- 3 就每一系列權證於 2006 年 11 月 29 日或前後刊發的補充上市文件。

重要資料

權證並無抵押

權證是在 2002 年 8 月 29 日經本公司董事會批准發行。權證為本公司而非其他人士的一般無抵押合約責任。倘若本公司清盤，權證彼此之間以至與本公司所有其他無抵押責任的地位相同（法律規定優先的責任除外）。閣下依賴本公司的信譽，就權證並無針對任何公司的權利。

Macquarie Bank Limited

本公司的長期債務評級如下：

評級機構	於推出日的評級
穆迪投資者服務公司	A2
標準普爾評級集團	A
惠譽（Fitch Ratings Ltd.）	A+

本公司不受香港聯合交易所有限公司證券上市規則第 15A.13(2)、(3)或(4)條所述的任何機構規管。本公司受澳洲審慎監管理局(Australian Prudential Regulation Authority)規管。

出售限制

權證並無亦不會根據 1933 年美國證券法（以經修訂者為準）（「證券法」）登記，且在任何時間均不會間接或直接在美國或向任何美國人士（定義見證券法）或代其或為其利益發售、出售、交付或買賣。

投資風險

權證的價格可能急升急跌，而閣下或會損失所有投資。倘若現金結算金額低於或等於零，權證將於期滿日到期而再無價值。

流通量提供者可能是權證僅有的市場參與者。權證的第二市場可能有限。

閣下必須：

- 審慎研究有關上市文件所載的風險因素；
- 完全瞭解潛在的風險與回報，並根據閣下的目標、經驗、財務及運作資源和其他相關情況，獨立判斷權證是否適合閣下；及
- 在認為必要的情況下諮詢有關顧問，協助閣下作出決定。

指數乃由恒指服務有限公司根據恒生資訊服務有限公司的批准發布及編製。恒生中國企業指數的標記及名稱屬恒生資訊服務有限公司專有。恒指服務有限公司及恒生資訊服務有限公司已同意我們可就本權證使用及引述指數，惟恒指服務有限公司及恒生資訊服務有限公司並無就(i)指數及其計算或任何其他與之有關的資料的準確性或完整性；或(ii)指數或其中任何成份或其所包含的資料作任何用途的適用性或適合性；或(iii)任何人士因使用指數或其中任何成份或其所包含的資料作任何用途而取得的結果，而向權證的任何經紀或權證持有人或任何其他人士作出保證或聲明或擔保，亦無就指數提供或默示任何類型的保證、聲明或擔保。恒指服務有限公司可隨時更改或修改計算及編製指數及其任何有關算式、成份股及系數的過程及基準，而無須作出通知。於適用法律容許的範圍內，恒指服務有限公司或恒生資訊服務有限公司不會因(i) MACQUARIE BANK LIMITED 就權證使用及/或引述指數；或(ii)恒指服務有限公司在計算指數時的任何失準、遺漏、失誤或錯誤；或(iii)有關計算指數而使用的並由任何其他人士提供的資料的任何失準、遺漏、失誤、錯誤或不完整；或(iv)任何經紀、權證持有人或任何其他處置權證的人士，因上述任何原因而直接或間接蒙受的任何經濟或其他損失承擔任何責任或法律責任。任何經紀、權證持有人或任何其他處置權證的人士，不得因有關權證的事宜，以任何形式向恒指服務有限公司及/或恒生資訊服務有限公司進行索償、法律行動或法律訴訟。任何經紀、權證持有人或任何其他處置權證的人士，須完全了解此免責聲明，並且不能依賴恒指服務有限公司及恒生資訊服務有限公司。為免產生疑問，本免責聲明並不會於任何經紀、權證持有人或任何其他人士與恒指服務有限公司及/或恒生資訊服務有限公司之間構成任何合約或準合約關係，亦不應視作已構成該等合約關係。

香港，2006 年 11 月 24 日