

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」）對本公佈之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表聲明，並明確表示概不就因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。

本公佈僅供參考，並不構成收購、購買或認購下文所述結構性產品的邀請或要約。

無抵押結構性產品
由
J.P. Morgan Structured Products B.V.（「發行人」）
（於荷蘭註冊成立的有限公司）

發行及由
JPMorgan Chase Bank, National Association
（根據美利堅合眾國法律組成的國家銀行組織）

無條件及不可撤回地擔保

有關華夏滬深 300 指數 ETF 結構性產品
提早終止金額的公佈

（證券代號：60047、60049、60802）

謹此提述我們日期為 2021 年 1 月 7 日，有關提早終止受影響結構性產品的公佈（「該公佈」）。除文義另行規定外，本公佈所使用的已界定詞彙具有該公佈所界定之相同涵義。

投資者應注意：

- (i) 受影響結構性產品已於 2021 年 1 月 11 日上午九時正起暫停買賣；
- (ii) 受影響結構性產品於 2021 年 1 月 11 日被提早終止；及
- (iii) 適用於不同上市結構性產品的估值方法會根據相關產品的實際條款及我們根據截至相關時間的實際相關對沖安排而採用的相關估值模式而有所不同。我們現時擬適用於受影響結構性產品的提早終止金額的估值方法僅適用於該產品，不得詮釋為適用於根據計劃已發行的其他類似上市結構性產品（不論是否與同一相關信託掛鈎）或作為指標。

提早終止金額

根據該公佈，我們已釐定下列受影響結構性產品的提早終止金額如下：

受影響結構性產品的證券代號	類別	相關信託/證券代號	行使價	資金成本平均值（根據年度化基準）	資金成本平均值（按貨幣價值）	買賣單位	每份牛熊證的提早終止金額	每手買賣單位的提早終止金額
60047	可贖回牛證	華夏滬深 300 指數 ETF (3188.HK)	48.800 港元	3.23%	0.006642 港元	2,000 份牛熊證	0.178135 港元	356.270 港元
60049	可贖回牛證	華夏滬深 300 指數 ETF (3188.HK)	43.800 港元	3.27%	0.006314 港元	2,000 份牛熊證	0.227125 港元	454.250 港元

受影響結構性產品的證券代號	類別	相關信託/證券代號	行使價	資金成本平均值（根據年度化基準）	資金成本平均值（按貨幣價值）	買賣單位	每份牛熊證的提早終止金額	每手買賣單位的提早終止金額
60802	可贖回牛證	華夏滬深300指數ETF (3188.HK)	53.800 港元	2.03%	0.006686 港元	2,000 份牛熊證	0.121313 港元	242.627 港元

在釐定受影響結構性產品（即牛熊證）的提早終止金額時，我們已將現有的定價模式（包括自提早終止日期（包括該日在內）起至原定計劃到期日（包括該日在內）的資金成本）用於受影響結構性產品。該定價模式的主要市場輸入因素為：

(a) 相關單位的收市價於估值期內按相對行使價來釐定。

就受影響結構性產品而言：

- (i) 收市價參考緊接提早終止日期前最後一個交易日（即 2021 年 1 月 8 日）的一個單位的收市價來釐定，即 67.100 港元；及
- (ii) 受影響結構性產品的估值期為緊接提早終止日期前一個交易日（即 2021 年 1 月 8 日），

(b) 於提早終止日期該日確定的其他因素，包括：

- (i) 信託自提早終止日期（包括該日在內）起至原定計劃到期日（包括該日在內）的利率及股息計劃；及
- (ii) 根據分別於 2021 年 1 月 7 日及 8 日收市時或緊接收市前所報發行人買入價及賣出價之中間價適用於有關係列自提早終止日期至原定計劃到期日期間的資金成本平均值。

任何有關對沖安排的平倉費用或其他費用將不會自受影響結構性產品的提早終止金額扣除。

每份牛熊證的提早終止金額根據應用各有關市場數據於我們的現有受影響結構性產品定價模式計算。

每手買賣單位的提早終止金額根據每份牛熊證的提早終止金額乘以受影響結構性產品的買賣單位計算。

我們確認，提早終止金額由我們以誠信為原則及商業上合理的方式釐定，並代表緊接提早終止前受影響結構性產品的公平市值。

結算程序

提早終止金額將於結算日（目前預期為 2021 年 1 月 14 日）透過轉賬至持有相關受影響結構性產品的中央結算系統賬戶中支付。向該賬戶支付提早終止金額將完全履行我們支付該提早終止金額的義務。投資者應注意，若閣下並非中央結算系統投資者戶口持有人，且並無中央結算系統戶口，則閣下將須依賴閣下的經紀以確保提早終止金額存入閣下的在經紀（及如適用，其託管商）的賬戶中。

提早終止金額的任何付款應扣除就該付款或與該提早終止相關的任何稅項、關稅、費用、徵費及其他費用。投資者還應與其經紀（如有）核對是否有任何應付經紀的費用。對於任何稅務機構就

提早終止金額的支付或任何與該提早終止有關而徵收的稅項、關稅或收費，我們概不負責。如有疑問，投資者應尋求獨立的稅務建議。

投資者查詢的聯絡詳情

受影響結構性產品投資者可透過以下方式獲取進一步資料：

- (a) 瀏覽我們的指定網站，網址為 <http://www.jpwmwarrants.com.hk>；或
- (b) 致電我們的熱線 +852 2800 7878。

J.P. Morgan Structured Products B.V.

香港，2021年1月12日