

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  
恒生科技指數  
受影響可贖回牛熊證的  
提早終止金額的公佈

謹此提述我們日期為 2021 年 1 月 18 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：

- (a) 受影響結構性產品已於 2021 年 2 月 2 日上午九時正（香港時間）起暫停買賣；
- (b) 受影響結構性產品於 2021 年 2 月 2 日被提早終止；及
- (c) 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指數掛鉤）或作為指標。

**提早終止金額**

根據該公佈，我們已釐定本公佈附表所載受影響結構性產品的提早終止金額。

在釐定各系列受影響結構性產品（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）用於有關係列的受影響結構性產品。該定價模式的主要市場輸入因素為：

- (a) 於估值日期確定的相關指數的收市水平與行使水平的比較。

就受影響結構性產品而言：

- (i) 收市水平參考於估值日期（即 2021 年 2 月 2 日）五分鐘間隔期間相關指數水平的平

均值<sup>1</sup>釐定，即10,032；及

- (ii) 受影響結構性產品的**估值日期**為提早終止日期（即2021年2月2日）。
- (b) 於提早終止日期該日確定的其他因素，包括：
- (i) 相關指數自提早終止日期（包括該日在內）起至原定計劃到期日（包括該日在內）的利率及股息息率；及
  - (ii) 根據緊接暫停交易日前兩個交易日（即2021年1月29日及2月1日）香港收市時或緊接收市前發行人的買入及賣出報價之中間價的適用於有關係列的推定資金成本平均值。

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2月5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.jpwwarrants.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2月3日

---

<sup>1</sup> 此反映了釐定結算有關指數期貨合約的最後結算價的方法，猶如有關指數期貨合約預定於估值日期到期。

附表：受影響結構性產品的提早終止金額

	受影響結構性產品的證券代號	類別	相關指數	行使水平	推定資金成本平均值（根據年度化基準）	推定資金成本平均值（港元）	買賣單位	每份牛熊證的提早終止金額（港元）	每手買賣單位的提早終止金額（港元）
1	57609	可贖回牛證	恒生科技指數	7,600	6.73%	0.00785	10,000 份可贖回牛熊證	0.250944	2509.440
2	57610	可贖回牛證	恒生科技指數	7,400	8.24%	0.00935	10,000 份可贖回牛熊證	0.272446	2724.460
3	57632	可贖回牛證	恒生科技指數	7,000	22.22%	0.00980	10,000 份可贖回牛熊證	0.312952	3129.520
4	58595	可贖回牛證	恒生科技指數	7,300	2.52%	0.01205	10,000 份可贖回牛熊證	0.283390	2833.900
5	58597	可贖回牛證	恒生科技指數	7,500	3.00%	0.00905	10,000 份可贖回牛熊證	0.261408	2614.080
6	58627	可贖回牛證	恒生科技指數	6,900	1.90%	0.00860	10,000 份可贖回牛熊證	0.319900	3199.000
7	58678	可贖回牛證	恒生科技指數	5,900	1.87%	0.01000	10,000 份可贖回牛熊證	0.421426	4214.260
8	60585	可贖回牛證	恒生科技指數	7,250	0.95%	0.00845	10,000 份可贖回牛熊證	0.286030	2860.300
9	60591	可贖回牛證	恒生科技指數	7,650	0.87%	0.00820	10,000 份可贖回牛熊證	0.245847	2458.470
10	63081	可贖回牛證	恒生科技指數	7,800	0.82%	0.00790	10,000 份可贖回牛熊證	0.230564	2305.640