

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

有關與中國海洋石油有限公司
掛鈎的受影響認股權證提早終止及暫停買賣的更新詳情公佈
（證券代號：17729、25011、27462、28187）

本公佈旨在通知投資者：

- (a) 就本公佈附表所述與中國海洋石油有限公司掛鈎的認股權證（證券代號：17729、27462、28187）（「受影響結構性產品」）而言：
 - (i) 受影響結構性產品的最後交易日更改為 2021 年 3 月 9 日；
 - (ii) 受影響結構性產品將自 2021 年 3 月 10 日起暫停買賣；
 - (iii) 受影響結構性產品將自 2021 年 3 月 15 日起提早終止；及
- (b) 與中國海洋石油有限公司掛鈎，證券代號為 25011 的認股權證（「範圍外認股權證」）將根據有關推出公佈及補充上市文件所指明的條款及細則，於原定計劃到期日（即 2021 年 2 月 5 日）到期。

概覽

謹此提述我們日期為2021年1月18日，有關受影響結構性產品提早終止及暫停買賣的公佈（「第一份公佈」）。

由於2021年1月27日香港收市後美利堅合眾國（「美國」）法律的最近期的變化（如第2部分中進一步描述），我們已決定：

- (a) 受影響結構性產品的提早終止日期根據有關條款及細則更改為2021年3月15日（「更新提早終止日期」）；及
- (b) 就範圍外認股權證而言，由於原定計劃到期日（即2021年2月5日）在更新提早終止日期之前，範圍外認股權證將根據有關推出公佈及補充上市文件所指明的條款及細則，於原定計劃到期日到期（而並非按提早終止金額）。

投資者務請注意以下與各系列受影響結構性產品有關的更新關鍵日期（各日期如下所詳述）：

更新關鍵日期	事件
2021年3月9日(星期二)	最後交易日
2021年3月10日(星期三)	暫停交易日
2021年3月8、9、10、11及12日	估值期間
2021年3月15日(星期一)	更新提早終止日期
	撤銷上市日期
2021年3月16日(星期二)	有關提早終止金額公佈的刊發日期
2021年3月18日(星期四)	向各持有人支付提早終止金額的更新結算日(定義見下文)

本公佈並無定義的詞語具有與受影響結構性產品有關的第一份公佈、相關基本上市文件及推出公佈及補充上市文件所賦予之涵義。凡於本公佈提及「我們」均指發行人，而「我們」及「我們的」等詞彙應按此詮釋。

為免生疑慮，本公佈僅適用於本公佈所述與中國海洋石油有限公司掛鈎的認股權證，而並不影響第一份公佈所列的任何其他結構性產品。

第1部分. 提早終止及暫停買賣

我們謹此宣佈：

- (a) 根據提早終止條件及修改條件，我們決定更改受影響結構性產品的提早終止日期至更新提早終止日期，即2021年3月15日。更新提早終止日期的設定與衍生認股權證（包括受影響結構性產品）的到期日的現行慣例一致，使得最後交易日至到期日之間有三個中央結算系統結算日。受影響結構性產品將在(i) 更新提早終止日期到期而不是本公佈附表所述的原定計劃到期日到期，及(ii)將於更新提早終止日期收市後終止上市；
- (b) 受影響結構性產品的最後一個交易日預期為2021年3月9日；及
- (c) 根據《聯交所證券上市規則》（「上市規則」）第6.02條的規定，我們將向聯交所提出申請，本公佈附表所述各系列受影響結構性產品將自2021年3月10日上午九時正（香港時間）起暫停買賣，而所有受影響結構性產品將暫停買賣，自2021年3月10日上午九時正（香港時間）起生效。

第2部分. 提早終止日期的更改

修改條件

根據適用於有關係列的受影響結構性產品的現金結算股份認股權證的條款及細則第9(B)條（「修改條件」），若我們認為整體上並無嚴重損害受影響結構性產品持有人的權益（毋須考慮任何個別受影響結構性產品持有人之情況或該修改於任何特定司法權區可能導致之稅務或其他後果），我們可修改受影響結構性產品的條款及細則，而無需取得受影響結構性產品持有人的同意。

提早終止日期的更改

截至本公佈日期，根據有關美國總統頒布的13959號行政命令（「**行政命令**」）「關於應對證券投資中共軍方企業的威脅」（經13974號行政命令修訂）的公開資料、外國資產控制辦公室（「**OFAC**」）發佈有關行政命令的常見問題（包括858、860、861、864、878及879）及OFAC於2021年1月27日（美國時間）發佈的「涉及若干中共軍方企業的證券的授權交易」一般許可證1A號，發行人集團已以誠信為原則及商業上合理的方式確定：

- (a) 有關受影響結構性產品的行政命令生效日期為2021年3月9日上午九時三十分東部標準時間（美國時間）；
- (b) 提早終止日期根據提早終止條件及修改條件更改為更新提早終止日期，即2021年3月15日，基於有關更改整體上並無嚴重損害受影響結構性產品持有人的權益；及
- (c) 受影響結構性產品將根據提早終止條件按下文第3部分中所詳述的適用提早終止金額於更新提早終止日期提早終止。

行政命令的禁止事項於2021年3月9日對受影響結構性產品是否適用，乃根據OFAC於2021年1月27日（美國時間）可於公開途徑取得的指引，並受限於可能就行政命令項下禁止範圍或生效日期發出的任何額外指引。

可能有其他與若干受限制公司掛鈎的上市結構性產品受行政命令影響。

美國政府已公開表示其擬根據該行政命令對更多公司實施制裁，而該等制裁將來可能會影響與該等新加的公司名稱相關的其他結構性產品。

我們會密切留意有關行政命令的發展動態。如我們的任何上市結構性產品與根據行政命令限制的相關公司名稱及證券有關連，我們適時會刊發進一步的公佈通知投資者。

第3部分. 提早終止安排

提早終止金額

在釐定各系列受影響結構性產品（認股權證）的提早終止金額時，我們擬將現有的定價模式用於有關係列的受影響結構性產品。

就一系列受影響結構性產品（認股權證）而言，該定價模式的主要市場輸入因素為：

- (a) 「**平均價**」與適用於有關係列的行使價的比較，
其中：
 - a. 「**平均價**」指一股股份於各估值日期之收市價之算術平均數；
 - b. 「**估值日期**」指緊接更新提早終止日期（即2021年3月15日）前的五個營業日之每日；
- (b) 參考緊接更新暫停交易日前兩個交易日（預期為2021年3月8日及3月9日）的香港收市時或緊接收市前發行人在市場上所報的買入價以及賣出價之中間價適用於有關係列的引伸波幅平均數；及
- (c) 更新提早終止日期與有關係列原定計劃到期日之間的時間值。

投資者務請注意，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股份掛鈎）或作為指標。

我們將不遲於更新提早終止日期後的交易日（目前預期為2021年3月16日）前透過於披露易網站刊發公佈將提早終止金額的實際金額通知各受影響結構性產品持有人。

結算程序

提早終止金額將於更新提早終止日期後的第三個中央結算系統結算日（目前預期為2021年3月18日，「更新結算日」）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在閣下經紀（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。

第4部分. 在更新提早終止日期前進行的受影響結構性產品買賣

投資者在受影響結構性產品暫停交易日前買賣受影響結構性產品時需特別謹慎，因為受影響結構性產品的價格可能會大幅波動，這可能會對投資者在受影響結構性產品的投資產生不利影響。

第5部分. 投資者查詢的聯絡方式

聯絡詳情

受影響結構性產品投資者可透過以下方式獲取與提早終止事件有關的進一步資料：

- (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。

本公佈包含重要信息，可能會對閣下於受影響結構性產品的投資產生負面影響。在投資或買賣受影響結構性產品之前，閣下必須仔細閱讀本公佈並（若適合）尋求專業意見。

J.P. Morgan Structured Products B.V.

香港，2021年1月29日

附表：受影響結構性產品列表

受影響結構性產品列表乃根據 2021 年 1 月 28 日收市時的市場資料。

	受影響結構性產品的證券代號	類別	相關股份/證券代號	行使價(港元)	原定計劃到期日	更新提早終止日期
1	17729	認購認股權證	中國海洋石油有限公司(883.HK)	10.90	2021年12月31日	2021年3月15日
2	27462	認沽認股權證	中國海洋石油有限公司(883.HK)	6.96	2021年3月31日	2021年3月15日
3	28187	認購認股權證	中國海洋石油有限公司(883.HK)	8.68	2021年3月31日	2021年3月15日