

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

有關與小米集團
掛鈎的受影響衍生認股權證及界內證（「小米認股權證」）
提早終止金額的公佈

謹此提述我們日期為 2021 年 2 月 19 日有關提早終止小米認股權證的公佈（「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) 小米認股權證已於 2021 年 3 月 16 日上午九時正（香港時間）起暫停買賣；
- (b) 小米認股權證已於 2021 年 3 月 19 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。我們現時擬適用於小米認股權證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。

提早終止金額

根據該公佈，我們已釐定本公佈附表所載小米認股權證的提早終止金額。

僅就衍生認股權證而言

在釐定各系列小米認股權證（衍生認股權證）的提早終止金額時，我們已將現有的定價模式用於有關係列的小米認股權證。

就一系列小米認股權證（衍生認股權證）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」指本公佈附表所指明的一股相關股份於各估值日期之收市價之算術平均數；
- b. 「估值日期」指緊接提早終止日期前的五個營業日之每日（即2021年3月12日、3月15

日、3月16日、3月17日及3月18日)；

- (b) 參考緊接暫停交易日前兩個交易日(即2021年3月12日及3月15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) 提早終止日期(即2021年3月19日)與有關係列原定計劃到期日之間的時間值。

任何有關對沖安排的平倉費用或其他費用將不會自小米認股權證的提早終止金額扣除。

每份衍生認股權證的提早終止金額根據應用各有關市場數據於我們現有小米認股權證的定價模式計算。

每手買賣單位的提早終止金額根據每份衍生認股權證的提早終止金額乘以小米認股權證的買賣單位計算。

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小米認股權證的公平市值。

僅就界內證而言

在釐定一系列小米認股權證(界內證)的提早終止金額時，我們已將現有的定價模式用於有關係列的小米認股權證。

就一系列小米認股權證(界內證)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上限價與下限價的比較，
其中：
 - a. 「平均價」指本公佈附表指明的一股相關股份於各估值日期之收市價之算術平均數；
 - b. 「估值日期」指緊接提早終止日期前的五個營業日之每日(即2021年3月12日、3月15日、3月16日、3月17日及3月18日)；
- (b) 參考緊接暫停交易日前之交易日(即2021年3月15日)的香港收市時或緊接收市前我們就有關係列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；及
- (c) 提早終止日期(即2021年3月19日)與有關係列原定計劃到期日之間的時間值。

任何有關對沖安排的平倉費用或其他費用將不會自小米認股權證的提早終止金額扣除。

每份界內證的提早終止金額根據應用各有關市場數據於我們現有小米認股權證的定價模式計算。

每手買賣單位的提早終止金額根據每份界內證的提早終止金額乘以小米認股權證的買賣單位計算。

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小米認股權證的公平市值。

結算程序

提早終止金額將於結算日(目前預期為2021年3月24日)透過轉賬至持有相關小米認股權證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

小米認股權證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.jpmwarrants.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3月22日

附表：小米認股權證的提早終止金額

1. 衍生認股權證

	小米認股權證的證券代號	類別	相關股份/證券代號	行使價(港元)	平均價(港元)	買賣單位(衍生認股權證)	每份衍生認股權證的提早終止金額(港元)	每手買賣單位的提早終止金額(港元)
1	11900	認購	小米集團(1810.HK)	14.90	25.17	2,000	1.047278	2094.556
2	15196	認沽	小米集團(1810.HK)	8.08	25.17	1,000	0	0.000
3	15330	認購	小米集團(1810.HK)	28.62	25.17	2,000	0.029591	59.182
4	16552	認沽	小米集團(1810.HK)	14.44	25.17	2,000	0	0.000
5	17081	認購	小米集團(1810.HK)	22.22	25.17	1,000	0.609963	609.963
6	18808	認沽	小米集團(1810.HK)	25.52	25.17	2,000	0.250424	500.848
7	18818	認購	小米集團(1810.HK)	36.73	25.17	2,000	0.000404	0.808
8	19852	認購	小米集團(1810.HK)	31.93	25.17	2,000	0.045355	90.710
9	20449	認沽	小米集團(1810.HK)	24.23	25.17	2,000	0.137	274.000
10	20923	認沽	小米集團(1810.HK)	12.82	25.17	2,000	0.000526	1.052
11	20992	認購	小米集團(1810.HK)	38.93	25.17	2,000	0.028969	57.938
12	24597	認購	小米集團(1810.HK)	20.33	25.17	2,000	0.505584	1011.168
13	25306	認購	小米集團(1810.HK)	23.23	25.17	2,000	0.320001	640.002
14	26229	認購	小米集團(1810.HK)	30.30	25.17	2,000	0.013	26.000
15	27195	認購	小米集團(1810.HK)	41.41	25.17	2,000	0.044155	88.310
16	27219	認沽	小米集團(1810.HK)	29.29	25.17	2,000	0.565478	1130.956
17	27232	認沽	小米集團(1810.HK)	26.66	25.17	2,000	0.365693	731.386
18	27950	認沽	小米集團(1810.HK)	17.71	25.17	2,000	0.016084	32.168
19	29109	認購	小米集團(1810.HK)	45.93	25.17	2,000	0.024636	49.272

2. 界內證

	小米認股 權證的 證券代號	類別	相關股份/ 證券代號	上限價 (港元)	下限價 (港元)	平均價 (港元)	買賣單 位(界 內證)	每份界內 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	48648	界內證	小米集團 (1810.HK)	22.00	18.00	25.17	1,000	0.4932	493.200