

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。

J.P.Morgan

無抵押結構性產品
歐式（現金結算）R類可贖回牛/熊證
（「牛熊證」）
之剩餘價值的估值通知

J.P. Morgan Structured Products B.V.
（於荷蘭註冊成立的有限公司）

發行及由
JPMorgan Chase Bank, National Association
（於美利堅合眾國紐約州註冊成立）

無條件及不可撤回地擔保

經辦人
J.P. Morgan Securities plc
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited

本通知未賦予定義的詞彙，與牛熊證的條款及細則（統稱「細則」）所定義者具有相同涵義。

J.P. Morgan Structured Products B.V.（「發行人」）謹此宣佈，根據細則，有關下表所述之牛熊證於聯交所開市前時段或持續交易時段或收市競價交易時段（視情況而定）於下表註明的時間（「強制贖回事件時間」）及日期（「強制贖回事件日期」）發生強制贖回事件（「強制贖回事件」）後，牛熊證的剩餘價值已釐定如下：

證券代號	類別	強制贖回事件日期	強制贖回事件時間	相關資產	發行額 (份牛熊證)	每項權益的牛熊證數目	權益	每手買賣單位 (份牛熊證)	行使價 (港元)	最高/最低交易價 (港元)	每手買賣單位的剩餘價值 (港元)
53334	牛證	26/2/2021	09:30:00	小米集團	200,000,000	50	1.00 股股份	10,000	25.500	25.150	0.000
54750	牛證	26/2/2021	09:20:27	騰訊控股有限公司	200,000,000	500	1.00 股股份	5,000	672.800	662.500	0.000
58900	牛證	26/2/2021	09:30:24	香港交易及結算所有限公司	200,000,000	500	1.00 股股份	5,000	479.800	468.000	0.000
58905	牛證	26/2/2021	09:20:27	美團	80,000,000	100	1.00 股股份	1,000	349.200	340.000	0.000
65596	牛證	26/2/2021	09:30:04	阿里巴巴集團控股有限公司	80,000,000	100	1.00 股股份	1,000	229.200	230.800	16.000

就一系列牛證而言，發行人根據以下程式計算每手買賣單位的剩餘價值：

$$\frac{\text{權益} \times (\text{最低交易價} - \text{行使價}) \times \text{一手買賣單位}}{\text{每項權益的牛熊證數目}}$$

就一系列熊證而言，發行人根據以下程式計算每手買賣單位的剩餘價值：

$$\frac{\text{權益} \times (\text{行使價} - \text{最高交易價}) \times \text{一手買賣單位}}{\text{每項權益的牛熊證數目}}$$

如無發生結算受阻事件，香港中央結算（代理人）有限公司（作為牛熊證的登記持有人）將於不遲於 2021年3月3日（即強制贖回事件估值期結束後三個中央結算系統結算日）收取剩餘價值（如有）。香港中央結算（代理人）有限公司會將該款項分派予有關經紀（及如適用，其託管人）的證券戶口或有關投資者的中央結算系統投資者證券戶口（視情況而定）。

J.P. Morgan Structured Products B.V.

2021年2月26日