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（「强制贖回事件時間」）及日期（「强制贖回事件日期」）發生强制贖回事件（「强制贖回事件」）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）	除數	指數貨幣金額（港元）	每手買賣單位（份牛熊證）	行使水平	最高/最低指數水平	每手買賣單位的剩餘價值（港元）
64383	熊證	30/12/2021	09:44:10	恒生指數	200,000,000	10,000	1.00	10,000	23,294.000	23,248.260	45.740
64387	牛證	30/12/2021	09:31:22	恒生指數	200,000,000	10,000	1.00	10,000	22,978.000	22,990.240	12.240
64400	牛證	30/12/2021	09:20:48	恒生指數	200,000,000	10,000	1.00	10,000	23,123.000	22,990.240	0.000

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：

$$\frac{\text{（最低指數水平 – 行使水平）x 一手買賣單位 x 指數貨幣金額}}{\text{除數}}$$

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：

$$\frac{\text{（行使水平 – 最高指數水平）x 一手買賣單位 x 指數貨幣金額}}{\text{除數}}$$

如無發生結算受阻事件，香港中央結算（代理人）有限公司（作爲牛熊證的登記持有人）將於不遲於 2022年1月5日（即强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）的證券户口或有關投資者的中央結算系統投資者證券户口（視情況而定）。

J.P. Morgan Structured Products B.V.
2021年12月30日