

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

有關小米集團
受影響可贖回牛熊證（「小米集團牛熊證」）的
提早終止金額的公佈

謹此提述我們日期為 2021 年 2 月 19 日，有關提早終止小米集團牛熊證的公佈（「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) 小米集團牛熊證已於 2021 年 3 月 16 日上午九時正（香港時間）起暫停買賣；
- (b) 小米集團牛熊證於 2021 年 3 月 16 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集團牛熊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集團牛熊證的提早終止金額。

在釐定各系列小米集團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）用於有關系列的小米集團牛熊證。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股份的收市價與行使價的比較。

就小米集團牛熊證而言：

- (i) 收市價參考於估值日期（即 2021 年 3 月 15 日）一股相關股份的收市價釐定，即 24.35 港元；及
- (ii) 小米集團牛熊證的估值日期為緊接提早終止日期前的交易日（即 2021 年 3 月 15 日）。

(b) 於提早終止日期該日確定的其他因素，包括：

- (i) 相關股份自提早終止日期（包括該日在內）起至原定計劃到期日（包括該日在內）的利率及股息率；及
- (ii) 根據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）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小米集團牛熊證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小米集團牛熊證的定價模式計算。

每手買賣單位的提早終止金額根據每份牛熊證的提早終止金額乘以小米集團牛熊證的買賣單位計算。

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集團牛熊證的公平市值。

結算程序

提早終止金額將於結算日（目前預期為2021年3月19日）透過轉賬至持有相關小米集團牛熊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

小米集團牛熊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.jpmmwarrants.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17日

附表：小米集團牛熊證的提早終止金額

	小米集團牛熊證的證券代號	類別	相關股份／證券代號	行使價 (港元)	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	52151	可贖回 牛證	小米集團 (1810.HK)	19.50	8.870%	0.00635	10,000 份可 贖回牛熊證	0.103408	1034.080
2	61673	可贖回 牛證	小米集團 (1810.HK)	15.58	10.437%	0.02985	2,000 份可贖 回牛熊證	0.907080	1814.160
3	61779	可贖回 熊證	小米集團 (1810.HK)	36.60	3.088%	0.00935	10,000 份可 贖回牛熊證	0.253839	2538.390
4	62968	可贖回 牛證	小米集團 (1810.HK)	16.58	30.952%	0.03515	200 份可贖 回牛熊證	0.812125	162.425
5	69955	可贖回 牛證	小米集團 (1810.HK)	18.50	3.167%	0.00305	10,000 份可 贖回牛熊證	0.120197	1201.970