

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

有關與中芯國際集成電路製造有限公司
掛鈎的受影響認股權證（「中芯國際認股權證」）的提早終止金額的公佈

謹此提述我們日期為2021年1月18日有關提早終止中芯國際認股權證的公佈（「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) 中芯國際認股權證已於2021年2月2日上午九時正（香港時間）起暫停買賣；
- (b) 中芯國際認股權證於2021年2月5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。我們現時擬適用於中芯國際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中芯國際認股權證的提早終止金額。

在釐定各系列中芯國際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中芯國際認股權證。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」指緊接提早終止日期前的五個營業日之每日（即2021年1月29日、2月1日、2月2日、2月3日及2月4日）；
- (b) 根據緊接暫停交易日前兩個交易日（即2021年1月29日及2021年2月1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引伸波幅平均數；及

(c) 提早終止日期（即2021年2月5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中芯國際認股權證的提早終止金額扣除。

每份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的現有中芯國際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認股權證的提早終止金額乘以中芯國際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中芯國際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2月10日）透過轉賬至持有相關中芯國際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

中芯國際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2月8日

附表：中芯國際認股權證的提早終止金額

	中芯國際認股權證的證券代號	類別	相關股份 / 證券代號	行使價 (港元)	買賣單位	平均價 (港元)	每份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	14454	認沽認股權證	中芯國際集成電路製造有限公司 (981.HK)	18.18	5,000 份認股權證	27.67	0.066734	333.670
2	16332	認購認股權證	中芯國際集成電路製造有限公司 (981.HK)	48.84	25,000 份認股權證	27.67	0.079124	1978.100
3	16465	認購認股權證	中芯國際集成電路製造有限公司 (981.HK)	30.03	5,000 份認股權證	27.67	0.131016	655.080
4	17375	認沽認股權證	中芯國際集成電路製造有限公司 (981.HK)	22.22	5,000 份認股權證	27.67	0.237542	1187.710
5	20405	認購認股權證	中芯國際集成電路製造有限公司 (981.HK)	36.83	25,000 份認股權證	27.67	0.122444	3061.100
6	22985	認購認股權證	中芯國際集成電路製造有限公司 (981.HK)	38.83	2,500 份認股權證	27.67	0.034697	86.743
7	22990	認購認股權證	中芯國際集成電路製造有限公司 (981.HK)	38.93	5,000 份認股權證	27.67	0.112969	564.845
8	24739	認購認股權證	中芯國際集成電路製造有限公司 (981.HK)	25.92	2,500 份認股權證	27.67	0.130474	326.185
9	26884	認購認股權證	中芯國際集成電路製造有限公司 (981.HK)	21.21	2,500 份認股權證	27.67	0.226027	565.068
10	27011	認沽認股權證	中芯國際集成電路製造有限公司 (981.HK)	15.15	5,000 份認股權證	27.67	0.007947	39.735

	中芯國際 認股權證 的 證券代號	類別	相關股份/ 證券代號	行使價 (港元)	買賣單位	平均價 (港元)	每份認股權 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)
11	28346	認購認股 權證	中芯國際集 成電路製造 有限公司 (981.HK)	20.02	5,000 份認 股權證	27.67	0.776765	3883.825
12	29848	認購認股 權證	中芯國際集 成電路製造 有限公司 (981.HK)	25.90	5,000 份認 股權證	27.67	0.358252	1791.260