

有關小米集團及中國海洋石油相關產品

提早終止的常見問題

關鍵日期列表

	小米集團 (1810.HK) 認股證及界內證	小米集團 (1810.HK) 牛熊證*	中海油 (883.HK) 認股證
最後交易日	2021/3/15	2021/3/15	2021/3/9
停牌日	2021/3/16	2021/3/16	2021/3/10
提早終止日	2021/3/19	2021/3/16	2021/3/15
估值日	2021/3/12, 15, 16, 17, 18	2021/3/15	2021/3/8, 9, 10, 11, 12
提早終止結算金額公布日	2021/3/22	2021/3/17	2021/3/16
提早終止結算金額支付日	2021/3/24	2021/3/19	2021/3/18

*小米集團牛熊證 3 月 12 及 15 日的資金成本平均數亦為市場因素之一，請參閱以下部分：

1) 如何釐定提早終止結算金額？

如相關公告所述，受影響產品的結算金額將主要參考以下市場因素：

小米集團認股證：

- 相關資產於估值日(2021 年 3 月 12, 15, 16, 17, 18 日)平均收市價
- 2021 年 3 月 12 日及 3 月 15 日收市時或緊接收市前，摩根大通買入價及賣出價之中間價的引伸波幅平均數
- 提早終止日期與原定計劃到期日之間的時間值

小米集團牛熊證：

- 相關資產於估值日(2021 年 3 月 15 日)收市價
- 資金成本、觸發強制收回事項的可能性、派息、對沖成本等其他因素
- 2021 年 3 月 12 日及 3 月 15 日收市時或緊接收市前，摩根大通買入價及賣出價之中間價的資金成本平均數

小米集團界內證:

- 相關資產於估值日(2021年3月12, 15, 16, 17, 18日)平均收市價
- 2021年3月15日收市時或緊接收市前, 摩根大通買入價及賣出價之中間價的引伸波幅平均數
- 提早終止日期與原定計劃到期日之間的時間值

中國海洋石油認股證:

- 相關資產於估值日(2021年3月8, 9, 10, 11, 12日)平均收市價
- 2021年3月8日及9日收市時或緊接收市前, 摩根大通買入價及賣出價之中間價的引伸波幅平均數
- 提早終止日期與原定計劃到期日之間的時間值

2) 今次將小米集團(1810.HK)及中海油(883.HK)相關產品提早除牌是基於什麼原因?

基於美國總統頒布的 13959 號行政命令 (經 13974 號行政命令修訂) 的公開資料及外國資產控制辦公室的相關發佈, 該等法律變動事件觸發了相關產品的提早終止條件。

3) 就受影響產品, 摩根大通為投資者提供了哪些提早終止安排?

中海油受影響產品最後交易日為 2021 年 3 月 9 日, 而小米集團的受影響產品最後交易日將為 2021 年 3 月 15 日。

摩根大通將於最後交易日期前, 如常提供買入及賣出報價。投資者可於此段期間選擇沽出相關受影響產品。

摩根大通根據公平合理準則作出提早終止產品相關安排，務求令持有受影響產品的投資者有更多時間去作出相關投資決定。我們亦將以一貫的定價模式為受影響產品提供報價，並致力維持穩定流通量。惟投資者務請注意，相關受影響產品的價格或會有所波動，投資者參與買賣時必須審慎行事。如對摩根大通提供的報價及流通量有任何疑問，可致電熱線+852 2800 7878 查詢。

如投資者未有於最後交易日沽出相關產品，產品將會提早終止結算。不同類型產品的結算方式及估值日會有差異。結算金額公布日及支付日期，請參考「關鍵日期列表」。^{*}

**如受影響產品的原定到期日早於提早終止日，該產品的到期日將維持不變，並將按照其相關補充上市文件列明的方式進行結算。*

4) 摩根大通如何確保所定的提早結算價為合理價？

摩根大通致力於根據公平合理準則去釐定提早終止結算價，以盡可能減少對於投資者及市場所產生的影響。我們一直與監管機構商議有關產品提早終止及結算的安排。

5) 摩根大通的其它衍生產品會否受到影響？

摩根大通將繼續密切關注美國行政命令及其相關指引的最新發展，及其對我們發行的投資產品所可能產生的影響。如有任何進一步消息，我們將盡快於香港交易所及摩根大通網站公布。

如欲了解更多有關詳情，[請按此查閱相關公告](#)。

如投資者有任何疑問，請致電熱線+852 2800 7878 查詢

免責聲明:

本「常見問題」(資料) 由摩根大通編製，僅供參考，並不能取代任何由摩根大通就受影響結構性產品所發布的條款及細則。本資料不構成任何投資、法律及稅務建議，同時亦不構成任何要約、建議、提呈出售或招攬購買任何所述產品。

投資者應根據閣下的投資目標、財務狀況及風險承受能力，為所作出任何關於投資產品及策略的決定負責。在投資或買賣受影響結構性產品之前，閣下必須仔細閱有關上市文件、補充上市文件及其他相關公佈並（若適合）尋求專業意見。本資料的最後更新時間為載列於首頁上的日期或另行通知。摩根大通並無義務或責任更新本資料的內容。摩根大通並不保證有關資料、數據、聲明或及其他有關資訊的完整性，並保留更改資料的權利。在不約束前文所述及乎合適用之法律範圍內的前提下，摩根大通不會為任何依賴或使用本資料而導致的任何損害（包括（但不限於）直接或間接、特別、附帶或相應而生的損害）、損失或開支承擔任何責任。此資料之所有權及全面擁有權屬摩根大通擁有，任何人均不得在未經授權下使用、傳播、分發或複製本資料全部或部份內容。