免責聲明

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公佈的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不對因公佈全部或任何部份內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。

剩餘價值的估值公佈

甲部 - 一般資料

發行人	J.P. Morgan Structured Products B.V.
擔保人 (如適用)	JPMorgan Chase Bank, National Association
相關資產種類	本地指數
強制贖回事件發生日期	2026年5月4日
剩餘價值付款日期	不遲於 2026年5月7日
公佈狀態	新公佈

乙部 - 牛熊證資料

證券代號	類別	強制贖回事件發生時間	相關資產	除數	指數貨幣金額 港元	買賣單位	行使水平	最高/最低指數水平	每份牛熊證的剩餘價值 港元	每個買賣單位的剩餘價值 港元
60796	熊證	09:30:06	恒生指數	10,000	1	10,000	26,261	26,326.44	0	0
60797	熊證	11:05:44	恒生指數	10,000	1	10,000	26,400	26,326.44	0.007356	73.56
61786	熊證	09:21:08	恒生指數	10,000	1	10,000	26,238	26,326.44	0	0
61808	熊證	09:38:36	恒生指數	10,000	1	10,000	26,380	26,326.44	0.005356	53.56
62136	熊證	09:30:06	恒生指數	10,000	1	10,000	26,270	26,326.44	0	0
62476	熊證	09:37:22	恒生指數	10,000	1	10,000	26,370	26,326.44	0.004356	43.56
63546	熊證	09:30:16	恒生指數	10,000	1	10,000	26,300	26,326.44	0	0
63653	熊證	09:21:08	恒生指數	10,000	1	10,000	26,180	26,326.44	0	0

證券代號	類別	強制贖回事件發生時間	相關資產	除數	指數貨幣金額 港元	買賣單位	行使水平	最高/最低指數水平	每份牛熊證的剩餘價值 港元	每個買賣單位的剩餘價值 港元
65010	熊證	09:21:08	恒生指數	10,000	1	10,000	25,900	26,326.44	0	0
65020	熊證	09:21:08	恒生指數	10,000	1	10,000	25,780	26,326.44	0	0

丙部 - 計算公式

發行人會根據下列公式計算釐定每個買賣單位的剩餘價值:

倘為指數牛證系列:

$$\frac{\text{（最低指數水平 - 行使水平）x 一個買賣單位 x 指數貨幣金額}}{\text{除數}}$$

倘為指數熊證系列:

$$\frac{\text{（行使水平 - 最高指數水平）x 一個買賣單位 x 指數貨幣金額}}{\text{除數}}$$

丁部 - 補充資料

1. 上述強制贖回事件發生日期及強制贖回事件發生時間分別為香港日期及香港時間

日期: 2026年5月4日