

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	海外指數
強制贖回事件發生日期	2026年9月30日
剩餘價值付款日期	不遲於 2026年10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 美元	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
49689	牛證	15:51:19	道瓊斯工業平均指數	390,000	1	10,000	50,650	50,546.54	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（按匯率兌換成（如適用）結算貨幣）

倘為指數牛證系列：

(最低指數水平 - 行使水平) x 一個買賣單位 x 指數貨幣金額

除數

倘為指數熊證系列：

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

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紐約日期及紐約時間。
2. 上述剩餘價值付款日期為香港日期。
3. 「匯率」指7.84554，即發行人經參考彭博專頁「BFIX」所顯示「USDHKD」匯率的中位報價所釐定於強制贖回事件估值期的最後一個指數營業日下午4時正或前後（紐約時間）美元兌港元的匯率（以每1個美元單位可兌港元單位的數目列示）。如於該日期的該時間因任何理由無法獲得該屏幕的匯率，則發行人應以誠信原則及商業上合理的方式釐定匯率。
4. 就一系列牛熊證而言，凡強制贖回事件發生時間欄指明為「-」者，強制贖回事件被視為已於觀察開始日上午9時正（香港時間）發生。

本公佈未賦予定義的詞彙，與牛熊證的條款及細則所定義者具有相同涵義。

日期： 2026年10月2日