

Notice regarding

**1.5-Year 7.50% p.a. Autocallable Barrier Reverse
Convertible Notes
(ISIN DE000JK0XF19; WKN JK0XF1),
linked to the ordinary share of Bâloise Holding AG,
the ordinary share of Swiss Life Holding AG and
the ordinary share of Zurich Insurance Group AG,
due at the latest on 29 August 2025,**

of

J.P. Morgan Structured Products B.V.,
guaranteed by JPMorgan Chase Bank, N.A.

The Aggregate Nominal Amount of Notes issued on the Issue Date will be equal to CHF 5,000,000.

The Initial Value in respect of (i) the ordinary share of Bâloise Holding AG is equal to CHF 141.00, (ii) the ordinary share of Swiss Life Holding AG is equal to CHF 646.20 and (iii) the ordinary share of Zurich Insurance Group AG is equal to CHF 458.90 (in each case subject to adjustment).

The Barrier Event Strike in respect of each Reference Asset is equal to 65.75% of its Initial Value (being in respect of (i) the ordinary share of Bâloise Holding AG CHF 92.71 (rounded), (ii) the ordinary share of Swiss Life Holding AG CHF 424.88 (rounded) and (iii) the ordinary share of Zurich Insurance Group AG CHF 301.73 (rounded)).

Mitteilung betreffend

***1,5-Jahres 7,50 % p.a. Autocallable Barrier Reverse
Convertible Schuldverschreibungen
(ISIN DE000JK0XF19; WKN JK0XF1),
bezogen auf die Stammaktie der Bâloise Holding AG,
die Stammaktie der Swiss Life Holding AG und
die Stammaktie der Zurich Insurance Group AG,
fällig spätestens am 29. August 2025***

der

*J.P. Morgan Structured Products B.V.,
garantiert durch JPMorgan Chase Bank, N.A.*

Der Gesamtnennbetrag der Schuldverschreibungen, die am Ausgabetag emittiert werden, beträgt CHF 5.000.000.

Der Anfangswert beträgt in Bezug auf (i) die Stammaktie der Bâloise Holding AG CHF 141,00, (ii) die Stammaktie der Swiss Life Holding AG CHF 646,20 und (iii) die Stammaktie der Zurich Insurance Group AG CHF 458,90 (jeweils vorbehaltlich einer Anpassung).

Der Barrierenereignis-Strikepreis in Bezug auf jeden Basiswert beträgt 65,75 % seines Anfangswertes (entspricht in Bezug auf (i) die Stammaktie der Bâloise Holding AG CHF 92,71 (gerundet), (ii) die Stammaktie der Swiss Life Holding AG CHF 424,88 (gerundet) und (iii) die Stammaktie der Zurich Insurance Group AG CHF 301,73 (gerundet)).

London, 23 February 2024

J.P. Morgan Structured Products B.V.