

Dieses Dokument stellt einen Nachtrag (der „**Nachtrag**“) gemäß § 16 des Wertpapierprospektgesetzes zu dem Basisprospekt vom 29. April 2016 zur Begebung von Wertpapieren mit Zinsstrukturen dar.



UniCredit Bank AG
München, Bundesrepublik Deutschland

Nachtrag vom 5. Januar 2017
zu dem

Basisprospekt vom 29. April 2016
zur Begebung von Wertpapieren mit Zinsstrukturen
unter dem Euro 50.000.000.000 Debt Issuance Programme der
UniCredit Bank AG
München, Bundesrepublik Deutschland

(der „**Basisprospekt**“):

Dieser Nachtrag ist im Zusammenhang mit dem Basisprospekt und, im Zusammenhang mit einer Begebung von Wertpapieren, mit den entsprechenden Endgültigen Bedingungen zu lesen. Daher gelten im Zusammenhang mit Emissionen unter dem Basisprospekt Bezugnahmen in den Endgültigen Bedingungen als Bezugnahmen auf den Basisprospekt unter Berücksichtigung des Nachtrags vom 21. Dezember 2016 sowie etwaiger weiterer Nachträge

Anleger, die vor der Veröffentlichung dieses Nachtrags eine auf den Erwerb oder die Zeichnung von Wertpapieren, die unter dem Basisprospekt begeben werden, gerichtete Willenserklärung abgegeben haben, haben das Recht, diese gemäß § 16 Absatz 3 Wertpapierprospektgesetz innerhalb einer Frist von zwei Werktagen nach Veröffentlichung des Nachtrags zu widerrufen, sofern der neue Umstand oder die Unrichtigkeit gemäß § 16 Absatz 1 Wertpapierprospektgesetz vor dem endgültigen Schluss des öffentlichen Angebots und vor der Lieferung der Wertpapiere eingetreten ist. Widerrufserklärungen können gemäß § 16 Absatz 3 in Verbindung mit § 8 Absatz 1 Satz 4 Wertpapierprospektgesetz an die UniCredit Bank AG, Abteilung LCD7SR Structured Securities & Regulatory, Arabellastraße 12, 81925 München, Deutschland, Fax-Nr.: +49-89-378 13944 gerichtet werden.

Dieser Nachtrag, der Nachtrag vom 21. Dezember 2016, der Basisprospekt sowie etwaige weitere Nachträge zu dem Basisprospekt werden auf der Internetseite www.onemarkets.de/basisprospekte oder einer Nachfolgesite veröffentlicht.

Die UniCredit Bank AG gibt folgende wesentliche Unrichtigkeit gemäß § 16 Absatz 1 Wertpapierprospektgesetz im Hinblick auf den Basisprospekt bekannt. Der Basisprospekt ist seit der Billigung am 2. Mai 2016 wesentlich unrichtig, da an einigen Stellen fälschlich auf die Währung Euro anstatt auf die Referenzwährung (wie auch beim Referenzsatz LIBOR, vgl z.B. Seite 126) abgestellt wird. Dass auf eine Referenzwährung abzustellen ist, belegt auch die Darstellung in der Wertpapierbeschreibung zum Produkttyp 2: Floater Wertpapiere (Seite 59). Daraus folgen die nachstehenden Änderungen im Basisprospekt:

1. Im Abschnitt „BEDINGUNGEN DER WERTPAPIERE“, „Teil C – Besondere Bedingungen der Wertpapiere“, „Produkttyp 2: Floater Wertpapiere“, in § 2 Verzinsung „(3) Referenzsatz“ im Fall von Wertpapieren mit einem CMS als Referenzsatz auf Seite 102 wird im ersten Satz anstelle der Wörter „der Referenzwährung“ die Wörter „in Euro“ verwendet. Der Absatz wird daher gestrichen und wie folgt neu gefasst:

„[Im Fall von Wertpapieren mit einem CMS als Referenzsatz gilt Folgendes:

- (3) *Referenzsatz:* "**Referenzsatz**" ist der Satz (ausgedrückt als Prozentsatz pro Jahr) für Swaptransaktionen in der Referenzwährung mit der entsprechenden Referenzsatz-Fälligkeit, der auf der Bildschirmseite zur Referenzsatzzeit (Ortszeit des Referenzsatz-Finanzentrums) am entsprechenden Zinsfeststellungstag angezeigt wird.

Sollte jeweils zur genannten Zeit die Bildschirmseite nicht zur Verfügung stehen oder keine solchen Swapsätze angezeigt werden, wird die Berechnungsstelle jede der Referenzbanken bitten, die mittleren jährlichen Swapsätze gegen ungefähr der Referenzsatzzeit am entsprechenden Zinsfeststellungstag zur Verfügung zu stellen.

Falls drei oder mehr solcher Angebote zur Verfügung gestellt werden, ist der Referenzsatz für den jeweiligen Zinsfeststellungstag das arithmetische Mittel (falls erforderlich, auf den nächsten hunderttausendstel Prozentpunkt gerundet, wobei 0,000005 aufgerundet wird) dieser Angebote, wobei der höchste (oder bei Gleichheit, einer der höchsten) und der niedrigste (oder bei Gleichheit, einer der niedrigsten) gestrichen werden. Werden weniger als drei Angebot zur Verfügung gestellt, wird die Berechnungsstelle den Referenzsatz nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) feststellen.]“

2. Im Abschnitt „BEDINGUNGEN DER WERTPAPIERE“, „Teil C – Besondere Bedingungen der Wertpapiere“, „Produkttyp 3: Range Accrual Wertpapiere“, in § 2 Verzinsung „(3) CMS“ im Fall von Wertpapieren mit einem CMS als Referenzsatz oder Range Accrual Referenzsatz auf Seite 115 wird im ersten Satz anstelle der Wörter „der Referenzwährung“ die Wörter „in Euro“ verwendet. Der Absatz wird daher gestrichen und wie folgt neu gefasst:

„[Im Fall von Wertpapieren mit einem CMS als Referenzsatz oder Range Accrual Referenzsatz gilt Folgendes:

- [(3)] *CMS:* "**CMS**" ist der Satz (ausgedrückt als Prozentsatz pro Jahr) für Swaptransaktionen in der Referenzwährung mit der entsprechenden [Referenzsatz-Fälligkeit][beziehungsweise][Range Accrual Referenzsatz-Fälligkeit], der auf der Bildschirmseite zur Referenzsatzzeit (Ortszeit des Referenzsatz-Finanzentrums) am entsprechenden [Zinsfeststellungstag][beziehungsweise][Beobachtungstag] angezeigt wird.

Sollte jeweils zur genannten Zeit die Bildschirmseite nicht zur Verfügung stehen oder keine solchen Swapsätze angezeigt werden, wird die Berechnungsstelle jede der Referenzbanken bitten, die mittleren jährlichen Swapsätze gegen ungefähr der Referenzsatzzeit am entsprechenden [Zinsfeststellungstag][beziehungsweise][Beobachtungstag] zur Verfügung zu stellen.

Falls drei oder mehr solcher Angebote zur Verfügung gestellt werden, ist der CMS für den jeweiligen [Zinsfeststellungstag][beziehungsweise][Beobachtungstag] das arithmetische Mittel (falls erforderlich, auf den nächsten hunderttausendstel Prozentpunkt gerundet, wobei 0,000005 aufgerundet wird) dieser Angebote, wobei der höchste (oder bei Gleichheit, einer

der höchsten) und der niedrigste (oder bei Gleichheit, einer der niedrigsten) gestrichen werden. Werden weniger als drei Angebote zur Verfügung gestellt, wird die Berechnungsstelle den CMS nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) feststellen.]“

3. Im Abschnitt BEDINGUNGEN DER WERTPAPIERE“, „Teil C – Besondere Bedingungen der Wertpapiere“, „Produkttyp 4: Digital Wertpapiere“, in § 2 Verzinsung „(3) satz“ im Fall von Wertpapieren mit einem CMS als Referenzsatz auf Seite 127 wird im ersten Satz anstelle der Wörter „der Referenzwährung“ die Wörter „in Euro“ verwendet. Der Absatz wird daher gestrichen und wie folgt neu gefasst:

„[Im Fall von Wertpapieren mit einem CMS als Referenzsatz gilt Folgendes:

- (3) *Referenzsatz:* "**Referenzsatz**" ist der Satz (ausgedrückt als Prozentsatz pro Jahr) für Swaptransaktionen in der Referenzwährung mit der entsprechenden Referenzsatz-Fälligkeit, der auf der Bildschirmseite zur Referenzsatzzeit (Ortszeit des Referenzsatz-Finanzentrums) am entsprechenden Zinsfeststellungstag angezeigt wird.

Sollte jeweils zur genannten Zeit die Bildschirmseite nicht zur Verfügung stehen oder keine solchen Swapsätze angezeigt werden, wird die Berechnungsstelle jede der Referenzbanken bitten, die mittleren jährlichen Swapsätze gegen ungefähr der Referenzsatzzeit am entsprechenden Zinsfeststellungstag zur Verfügung zu stellen.

Falls drei oder mehr solcher Angebote zur Verfügung gestellt werden, ist der Referenzsatz für den jeweiligen Zinsfeststellungstag das arithmetische Mittel (falls erforderlich, auf den nächsten hunderttausendstel Prozentpunkt gerundet, wobei 0,000005 aufgerundet wird) dieser Angebote, wobei der höchste (oder bei Gleichheit, einer der höchsten) und der niedrigste (oder bei Gleichheit, einer der niedrigsten) gestrichen werden. Werden weniger als drei Angebot zur Verfügung gestellt, wird die Berechnungsstelle den Referenzsatz nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) feststellen.]“

UniCredit Bank AG
Arabellastraße 12,
81925 München

unterzeichnet durch

Florian Schniewind

Nicole Weyrich