

# UNICREDIT BANK AG

Mitteilung gemäß den Wertpapierbedingungen in Bezug auf die folgenden

HVB Turbo Open End Wertpapiere mit den folgenden ISINs

|              |              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|--------------|
| DE000HR45SB9 | DE000HR46LM9 | DE000HR4E957 | DE000HR4J5B7 |
|--------------|--------------|--------------|--------------|

und die folgenden

HVB Mini Future Wertpapiere mit den folgenden ISINs

|              |              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|--------------|
| DE000HR3YMM5 | DE000HR43CV6 | DE000HR45VH0 | DE000HR48989 |
| DE000HR4EBY3 | DE000HR4J7T5 |              |              |

(die „Wertpapiere“)

**Mitteilung aufgrund der Einstellung des 1-Monats-USD-Libor:**

Am 5. März 2021 hat die Financial Conduct Authority bekannt gegeben, dass der 1-Monats-USD-Libor unmittelbar nach dem 30. Juni 2023 nicht mehr für den zugrunde liegenden Markt und die wirtschaftliche Realität, die dieser abbilden soll, repräsentativ sein wird und dass diese mangelnde Repräsentativität auch nicht wieder hergestellt wird. Zudem hat die ICE Benchmark Administration Limited als Administrator des 1-Monats-USD-Libor am 5. März 2021 bekannt gegeben, dass sie den 1-Monats-USD-Libor zum 30. Juni 2023 einstellen will.

Damit stellt die Berechnungsstelle gemäß den Wertpapierbedingungen nach ihrem billigen Ermessen fest, dass zum unmittelbar dem 30. Juni 2023 folgenden Zinsfeststellungstag, dies ist der letzte Handelstag im Juli 2023, der 31. Juli 2023 der Referenzsatz gemäß § 9 bzw. § 10 der Besonderen Bedingungen nicht mehr bereitgestellt wird.

Die Berechnungsstelle hat daher einen Ersatzreferenzsatz nach § 9 bzw. § 10 der Besonderen Bedingungen bestimmt. Dies ist der SOFR (Secured Overnight Financing Rate). Administrator des SOFR ist die Federal Reserve Bank of New York.

Der SOFR wurde vom *Alternative Reference Rates Committee* (ARRC), einer vom Federal Reserve Board und der Federal Reserve Bank of New York einberufenen Gruppe privater Marktteilnehmer, allgemein als Nachfolgesatz für den USD LIBOR empfohlen, um den mit der Abschaffung des LIBOR verbundenen Risiken zu begegnen und einen geeigneten alternativen Referenzsatz für Finanzkontrakte zu ermitteln. Der SOFR wird daher weithin als Ersatzreferenzsatz für Wertpapiere verwendet, die auf USD-LIBOR-Sätze referenzieren. Je nach Instrument und tatsächlicher Funktion des Referenzsatzes werden verschiedene Varianten auf der Grundlage des SOFR als Ersatz für den USD LIBOR-Satz verwendet. Nach Ansicht der Berechnungsstelle ist der Overnight-SOFR (ohne Laufzeitanpassung) ein wirtschaftlich geeigneter Referenzsatz und wird typischerweise als Ersatzreferenzsatz für Wertpapiere verwendet, bei denen der Referenzsatz zur Ermittlung der Finanzierungskosten in Turbo Open End- und Mini-Future-Produkten verwendet wird. Dementsprechend hat die Berechnungsstelle den Overnight-SOFR als Ersatzreferenzsatz für die Wertpapiere festgelegt.

SOFR ist ein Übernachtzinssatz (Overnight rate). Dadurch wird zudem eine Anpassung der Emissionsbedingungen erforderlich, um SOFR im Einklang mit der Marktpaxis zu verwenden.

Die Bestimmung des Ersatzreferenzsatzes und die Änderung der Wertpapierbedingungen wird zum Anpassungstag am 1. August 2023 ("Wirksamkeitstag") verbindlich.

Die Emissionsbedingungen wurden von der Berechnungsstelle nach billigem Ermessen wie folgt zum Wirksamkeitstag angepasst:

*Änderung der nachfolgenden Definition in § 2 der Produkt- und Basiswertdaten:*

„Referenzsatzbildschirmseite (1)

Reuters USDSOFR=

*Änderung der nachfolgenden Definition in § 1 der Besonderen Bedingungen:*

Die Definition "**Referenzsatz**" wird wie folgt ersetzt:

„Der "**Referenzsatz**" wird von der Berechnungsstelle an jedem Anpassungstag neu festgestellt und ist für jeden Zeitraum von dem entsprechenden Anpassungstag (ausschließlich) bis zum unmittelbar nächsten Anpassungstag (einschließlich) die Differenz aus:

- (i) SOFR (Secured Overnight Financing Rate) (ausgedrückt als Prozentsatz pro Jahr) wie auf der Referenzsatzbildschirmseite (1) am letzten Handelstag des unmittelbar vorausgehenden Kalendermonats (jeweils ein "**Zinsfeststellungstag**"), und
- (ii) dem Angebotssatz (ausgedrückt als Prozentsatz pro Jahr) für Einlagen in der Zählerwährung für eine Laufzeit von einem Monat am Zinsfeststellungstag, wie auf der Referenzsatzbildschirmseite (2) angezeigt."

Sollte jeweils eine oder beide Referenzsatzbildschirmseiten am Zinsfeststellungstag nicht zur Verfügung stehen oder kein Angebotssatz angezeigt werden, so wird die Berechnungsstelle den zuletzt auf der Referenzsatzbildschirmseite veröffentlichten Satz verwenden bzw. den jeweiligen Angebotssatz nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) feststellen."

Die Definitionen Referenzbanken, Referenzsatzfinanzzentrum und Referenzsatzzeit werden nicht mehr verwendet.

Die Wertpapierbedingungen, diese Mitteilung und weitere Informationen werden auf [www.onemarkets.de](http://www.onemarkets.de) (für Anleger in Deutschland und Luxemburg) und [www.onemarkets.at](http://www.onemarkets.at) (für Anleger in Österreich) veröffentlicht und Kopien können kostenlos in den Geschäftsräumen der UniCredit Bank AG, OSU1CA, Arabellastr. 12, 81927 München erhalten werden.

München, 28. Juli 2023

**UniCredit Bank AG**