

UNICREDIT BANK AG

Mitteilung gemäß den Wertpapierbedingungen in Bezug auf die folgenden

HVB Turbo Open End Wertpapiere mit den folgenden ISINs

DE000HR51F13	DE000HR5AVQ2	DE000HR5FPE9	DE000HR5H7K5	DE000HR5L3B7
DE000HR5PKE9	DE000HR5RTC0	DE000HR5RTB2	DE000HR5RTA4	DE000HR5SQD2
DE000HR5SQC4	DE000HR5TN35	DE000HR5TN50	DE000HR5TN43	DE000HR6DG23
DE000HR6DG15	DE000HR6DG56	DE000HR6DG64	DE000HR6DG31	DE000HR6DG49
DE000HR6DG72	DE000HR6E6L7	DE000HR6YKK6	DE000HR7BXN9	DE000HR7BXM1
DE000HR7BXL3	DE000HR7CED8	DE000HR7KJZ3	DE000HR7KK01	DE000HR7NWC9
DE000HR7V8B2	DE000HR7VX03	DE000HR7VX11	DE000HR7WM21	DE000HR83QA6
DE000HR83Q79	DE000HR83Q95	DE000HR83QB4	DE000HR83Q87	DE000HR9UN46
DE000HR9UN53	DE000HB2NZL2	DE000HB2NZK4	DE000HB2SZB2	DE000HB3SXJ8
DE000HB3SXG4	DE000HB3SXH2	DE000HC03X66	DE000HC03X58	DE000HC076V6
DE000HC076U8	DE000HC08DX5	DE000HC09XJ0	DE000HC09XC5	DE000HC09XL6
DE000HC09XU7	DE000HC09XV5	DE000HC09XF8	DE000HC09XH4	DE000HC09XQ5
DE000HC09XG6	DE000HC09XN2	DE000HC09XT9	DE000HC09XE1	DE000HC09XM4
DE000HC09XP7	DE000HC09XB7	DE000HC09XR3	DE000HC09XK8	DE000HC09XS1
DE000HC09XD3	DE000HC0GJX8	DE000HC0GJW0	DE000HC0GJY6	DE000HC0GJZ3
DE000HC0JDT3	DE000HC0JDU1	DE000HC0JDW7	DE000HC0JDV9	DE000HC0JDR7
DE000HC0JDS5	DE000HC0NSZ0	DE000HC0PZ16	DE000HC0PZ08	DE000HC0VQA0
DE000HC0VQ92				

(die „Wertpapiere“)

Mitteilung aufgrund des Eintritts eines Referenzsatz-Einstellungsereignisses:

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, ein Referenzsatz-Einstellungsereignis nach Absatz (e), (a) bzw. (b) der betreffenden Definition eintritt.

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-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 Marktpraxis 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 (für Anleger in Deutschland und Luxemburg) und 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