

Mitteilung an Wertpapierinhaber: Indexersetzung



BNP PARIBAS

Datum: 7. Februar 2017

100.000 OPEN END ZERTIFIKATE BEZOGEN AUF DEN DAXPLUS[®] MAXIMUM SHARPE RATIO
GERMANY (TRI) INDEX

ISIN : DE000AA0KF06

WKN : AA0KF0

Ausgabetag: 7. August 2007

(Die **“Wertpapiere”**)

Emittiert unter dem Basisprospekt für Zertifikate vom 1. Juli 2007

(Der **“Basisprospekt”**)

BNP Paribas Arbitrage Issuance BV ist die Emittentin (**“die Emittentin”**) der oben genannten Wertpapiere (gemäß dem Verfahren zur Übertragung von Bankgeschäften zwischen The Royal Bank of Scotland plc und BNP Paribas S.A., genehmigt durch das zuständige Gericht in Schottland am 19. November 2015 mit Wirkung zum 7. Dezember 2015)

Indexersetzung

Diese Mitteilung ist zusammen mit den Allgemeinen Bedingungen (*General Conditions*, die **„Allgemeinen Bedingungen“**) sowie den Produktbedingungen (*Product Conditions*, die **„Produktbedingungen“**), und zusammen mit den Allgemeinen Bedingungen, die **“Bedingungen”** (*Conditions*) der Wertpapiere zu lesen. Diese sind in den Endgültigen Bedingungen (*Final Terms*) Nr. 116 vom 6. August 2007 (**„Endgültige Bedingungen“**), dem Basisprospekt, jeweils nachgetragen oder geändert, und dem Basisprospekt Nr. 3 für das öffentliche Angebot von Open End Zertifikaten vom 3. Juni 2016 enthalten.

Die Emittentin gibt hiermit den Wertpapierinhabern gemäß Allgemeiner Bedingung 4 (*Notices*) das Auftreten einer Absicherungsstörung (*Hedging Disruption Event*) gemäß Punkt (b) der Allgemeinen Bedingung 5 (*Hedging Disruption*) bekannt.

Gemäß Punkt (c) der Allgemeinen Bedingung 5 (*Hedging Disruption*) hat die Emittentin beschlossen, die Bedingungen der Wertpapiere anzupassen. Folglich wird der existierende Index, der den Wertpapieren zugrunde liegt - DAXPlus® Maximum Sharpe Ratio Germany (TRI) Index (Bloomberg Code: DXMSG <INDEX> / ISIN: DE000A0METL2) – durch folgenden Index ersetzt: DAXPlus® Maximum Sharpe Ratio Germany EUR (NR) (Bloomberg Code: DXMSGN <INDEX> / ISIN: DE000A1EXPL5). Der angesetzte Ersetzungstag ist der 15. Februar 2017.

Die Wertpapierinhaber werden ebenfalls darüber informiert, dass der Wert des Bezugsverhältnisses (wie in den Endgültigen Bedingungen definiert) angepasst wird, um den theoretischen Zertifikatswert beizubehalten. Der neue Wert des Bezugsverhältnisses steht den Wertpapierinhabern ab dem Ersetzungstag unter folgendem Weblink zur Verfügung:

<https://www.derivate.bnpparibas.com/zertifikat/details/daxplus-maximum-sharpe-ratio-germany-performance-tr-index-open-end-zertifikat/de000aa0kf06>

In dieser Mitteilung haben großgeschriebene Begriffe, die nicht definiert sind, dieselbe Bedeutung wie in den Bedingungen der Wertpapiere.

Für weitere Informationen wenden Sie sich bitte an die Emittentin.

BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V.

Notice to Holders: Substitution of Index



BNP PARIBAS

Dated: 7 February 2017

100,000 DAXPLUS®MAXIMUM SHARPE RATIO GERMANY (TRI) INDEX OPEN END CERTIFICATES

ISIN : DE000AA0KF06

WKN : AA0KF0

Issue Date: 7 August 2007

(The “**Securities**”)

Issued under the Base Prospectus relating to Certificates dated 1 July 2007

(The “**Base Prospectus**”)

BNP Paribas Arbitrage Issuance BV is the issuer (“**the Issuer**”) of the above mentioned Securities (pursuant to a banking business transfer scheme between The Royal Bank of Scotland plc and BNP Paribas S.A. approved by the Court of Session in Scotland on 19 November 2015 which took effect on 7 December 2015)

Substitution of the Index

This Notice should be read in conjunction with the General Conditions (the “**General Conditions**”) and the Product Conditions (the “**Product Conditions**”) and together with the General Conditions, the “**Conditions**”) relating to the Securities as set out in the Final Terms no. 116 dated 6 August 2007 (the “**Final Terms**”), the Base Prospectus, as supplemented or amended from time to time, and the Base Prospectus n°3 for public offer of Open End Certificates dated 3 June 2016

The Issuer hereby gives notice to the Holders of the Securities in accordance with General Condition 4 (*Notices*) relating to the Securities of the occurrence of a Hedging Disruption Event as defined in point (b) of the General Condition 5 (*Hedging Disruption*).

Pursuant to point (c) of the General Condition 5 (*Hedging Disruption*) the Issuer has decided to adjust the Conditions of the Securities. Consequently, the existing Index underlying the Securities - DAXPlus® Maximum Sharpe Ratio Germany (TRI) Index (Bloomberg Code: DXMSG <INDEX> / ISIN: DE000A0METL2) – will be substituted by the following Index: DAXPlus® Maximum Sharpe Ratio

Germany EUR (NR) (Bloomberg Code: DXMSGN <INDEX> / ISIN: DE000A1EXPL5). The scheduled substitution date is 15 February 2017.

Holders are also informed that the value of the Entitlement, as defined in the Final Terms, will be adjusted in order to maintain the theoretical value of the Certificates. The new value of the Entitlement will be available to Holders from the scheduled substitution date via the following website link:

<https://www.derivate.bnpparibas.com/zertifikat/details/daxplus-maximum-sharpe-ratio-germany-performance-tr-index-open-end-zertifikat/de000aa0kf06>

Capitalised terms not defined in this notice shall have the same meaning given to them in the conditions of the Securities.

For further information, please contact the Issuer.

BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V.