

**BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH,  
Frankfurt am Main  
(die "Emittentin")**

**LEI 549300TS3U4JKMR1B479**

**Endgültige Angebotsbedingungen Nr. 37155-002  
vom 23. September 2021**

**im Zusammenhang mit dem Basisprospekt vom 19. Februar 2021 zur Neuemission sowie  
zur Fortsetzung des öffentlichen Angebots und zur Erhöhung des Emissionsvolumens  
von Zertifikaten, Aktienanleihen, Anleihen bezogen auf Indizes, Aktien, Metalle,  
Terminkontrakte, Rohstoffe, börsennotierte Fondsanteile, nicht börsennotierte  
Fondsanteile, Währungswechselkurse, Referenzsätze und/oder Depositary Receipts  
sowie einen Korb von Indizes, Aktien, Metallen, Terminkontrakten, Rohstoffen,  
börsennotierten Fondsanteilen, nicht börsennotierten Fondsanteilen,  
Währungswechselkursen, Referenzsätzen und/oder Depositary Receipts**

**zur Begebung von**

**Capped Bonus / Capped Bonus<sup>PRO</sup> Zertifikaten**

**bezogen auf Indizes**

**Hinweis: Der vorgenannte Basisprospekt vom 19. Februar 2021, unter dem die in diesen  
Endgültigen Angebotsbedingungen beschriebenen Wertpapiere begeben werden, verliert  
am 19. Februar 2022 seine Gültigkeit. Der Nachfolgebasisprospekt wird unter  
[www.derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte](http://www.derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte) veröffentlicht.**

Ab diesem Zeitpunkt sind diese Endgültigen Angebotsbedingungen für diejenigen Wertpapiere, deren Laufzeit bis zum 19. Februar 2022 nicht beendet worden ist, im Zusammenhang mit dem jeweils aktuellen Basisprospekt der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH, Frankfurt am Main, zur Neuemission sowie zur Fortsetzung des öffentlichen Angebots und zur Erhöhung des Emissionsvolumens von Zertifikaten, Aktienanleihen, Anleihen zu lesen, der dem Basisprospekt vom 19. Februar 2021 nachfolgt.

**Die Endgültigen Bedingungen wurden für die Zwecke der Verordnung (EU) 2017/1129 abgefasst. Die Endgültigen Bedingungen sind zusammen mit dem Basisprospekt vom 19. Februar 2021 (wie nachgetragen durch die Nachträge vom 9. März 2021, vom 20. April 2021, vom 22. April 2021, vom 26. Mai 2021 und vom 25. August 2021 einschließlich etwaiger zukünftiger Nachträge) und einschließlich der Dokumente, aus denen Angaben mittels Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen werden, zu lesen. Den Endgültigen Bedingungen ist eine Zusammenfassung für die einzelne Emission angefügt. Der Basisprospekt, die Dokumente, aus denen Angaben mittels Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen werden, etwaige Nachträge zum Basisprospekt sowie die Endgültigen Bedingungen der Wertpapiere sind am Sitz der Emittentin, Europa-Allee 12, 60327 Frankfurt am Main kostenlos erhältlich und können auf der Internetseite [www.derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte](http://www.derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte) bzw. die Endgültigen Bedingungen auf der Internetseite [www.derivate.bnpparibas.com/zertifikate](http://www.derivate.bnpparibas.com/zertifikate) abgerufen werden.**

unbedingt garantiert durch  
**BNP Paribas S.A.  
Paris, Frankreich  
(die "Garantin")**

und

angeboten durch  
**BNP Paribas Arbitrage S.N.C.  
Paris, Frankreich  
(die "Anbieterin")**

**Dieses Dokument enthält die endgültigen Angaben zu den Wertpapieren und die Endgültigen Wertpapierbedingungen und stellt die Endgültigen Bedingungen des Angebotes von Capped Bonus / Capped Bonus<sup>PRO</sup> Zertifikaten bezogen auf Indizes (im Nachfolgenden auch als "Basiswert" bezeichnet) dar.**

Die Wertpapierbedingungen für die betreffende Serie sind in einen Abschnitt A, Teil I (Produktspezifische Bedingungen), einen Abschnitt A, Teil II (Basiswertspezifische Bedingungen), und einen Abschnitt B (Allgemeine Bedingungen) aufgeteilt. Der Abschnitt A der Wertpapierbedingungen ist durch die nachfolgenden Endgültigen Bedingungen vervollständigt. Der Abschnitt B der Wertpapierbedingungen ist bereits vollständig im Basisprospekt im Abschnitt XII. Wertpapierbedingungen aufgeführt.

Um sämtliche Angaben zu erhalten, ist der Basisprospekt einschließlich der Dokumente, aus denen Angaben mittels Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen werden, und etwaiger Nachträge in Zusammenhang mit den Endgültigen Bedingungen zu lesen. Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder geregelt, haben die in diesem Dokument verwendeten Begriffe die ihnen im Basisprospekt zugewiesene Bedeutung.

Die Endgültigen Bedingungen stellen für die betreffende Serie von Wertpapieren die endgültigen Wertpapierbedingungen dar (die "Endgültigen Wertpapierbedingungen"). Sofern und soweit die im Basisprospekt enthaltenen Wertpapierbedingungen von den Endgültigen Wertpapierbedingungen abweichen, sind die Endgültigen Wertpapierbedingungen maßgeblich.

## ANGABEN ÜBER DEN BASISWERT

Der den Wertpapieren zugewiesene Basiswert ist der Tabelle in den Wertpapierbedingungen (§ 1) zu entnehmen. Nachfolgender Tabelle sind der Basiswert sowie die öffentlich zugängliche Internetseite, auf der derzeit Angaben in Bezug auf die vergangene und künftige Wert- und Kursentwicklung des Basiswerts und dessen Volatilität kostenlos abrufbar sind, zu entnehmen.

Basiswert mit ISIN	Internetseite
The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), ISIN US2605661048	<a href="http://www.eu.spindices.com">www.eu.spindices.com</a>

Die auf der Internetseite erhältlichen Informationen stellen Angaben Dritter dar. Die Emittentin hat diese Informationen keiner inhaltlichen Überprüfung unterzogen.

**Alle in diesem Prospekt enthaltenen Indexangaben, einschließlich der Informationen über die Berechnung und über die Veränderungen der einzelnen Bestandteile, beruhen auf öffentlich zugänglichen Informationen, die von der bzw. den Referenzstelle(n) erstellt wurden. Die Emittentin hat diese Informationen keiner inhaltlichen Überprüfung unterzogen.**

### **Beschreibung des Index:**

#### **Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index)**

Der Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index) ("Dow Jones Industrial Average®") ist ein Index bestehend aus Aktien von 30 Unternehmen aus den Vereinigten Staaten von Amerika. Der Dow Jones Industrial Average® deckt alle Industrien bis auf die Transport- und Versorgungsindustrie ab. Die Auswahl der Aktien erfolgt nicht auf Grundlage von quantitativen Kriterien. Sie erfolgt prinzipiell auf Basis von Reputation und nachhaltigem Wachstum der zugrundeliegenden Unternehmen und dem Interesse zahlreicher Investoren. Die Wahrung einer adäquaten Sektorrepräsentanz ist ein zusätzliches Auswahlkriterium.

Der Index ist geistiges Eigentum der S&P Dow Jones Indices LLC.

Der Dow Jones Industrial Average® wird in Echtzeit (real-time) in USD berechnet und veröffentlicht.

Die Berechnung des Index erfolgt preisgewichtet und adjustiert um Corporate Actions.

Die Emittentin übernimmt weder für die Aktualität noch für die Verfügbarkeit der Kursdaten und Informationen die Gewähr. Auf während der Laufzeit der Wertpapiere erfolgende Aktualisierungen des Index wird von der Emittentin nicht hingewiesen.

**Obwohl gegenwärtig bestimmte Methoden zur Index-Berechnung angewendet werden, kann keine Gewährleistung dafür übernommen werden, dass die Berechnungsmethoden nicht in einer Weise abgewandelt oder verändert werden, die unter Umständen die Zahlung an die Inhaber von Wertpapieren beeinflussen können.**

### **Lizenzvermerk:**

#### **The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index)**

"Dow Jones" und Dow Jones Industrial Average® sind Dienstleistungsmarken von S&P Dow Jones Indices LLC. beziehungsweise an diese lizenzierte und wurden zur Verwendung für bestimmte Zwecke von BNP Paribas S.A. und jeder von BNP Paribas gehaltenen Tochtergesellschaft lizenziert. Die von BNP Paribas S.A. und von ihren Tochtergesellschaften auf dem The Dow Jones Industrial Average® basierenden Wertpapiere werden von S&P Dow Jones Indices LLC. nicht gesponsert, unterstützt, verkauft oder vertrieben. S&P Dow Jones Indices LLC. gibt keine Zusicherung, dass eine Veranlagung in solche Produkte anzuraten ist.

Die Wertpapiere werden weder von S&P Dow Jones Indices LLC. noch von irgendeinem seiner Lizenzgeber gesponsert, unterstützt, verkauft oder vertrieben. Weder S&P Dow Jones Indices LLC. noch irgendeiner seiner Lizenzgeber machen Zusagen oder übernehmen irgendeine Gewährleistung, weder ausdrücklich noch implizit, gegenüber den Inhabern der Wertpapiere oder gegenüber anderen Personen darüber, ob eine Veranlagung in die Wertpapiere allgemein oder in die Wertpapiere im Besonderen anzuraten ist. Die Beziehung von S&P Dow Jones Indices LLC. und seinen Lizenzgebern zu den Lizenznehmern ist eingeschränkt auf die eines Lizenzgebers für den The Dow Jones Industrial Average®, der ohne Berücksichtigung des Lizenznehmers oder der Wertpapiere festgesetzt, zusammengestellt und kalkuliert wird. Weder S&P Dow Jones Indices LLC. noch irgendeiner der Lizenzgeber hat eine Verpflichtung, die Belange der Lizenznehmer oder die der Inhaber der Wertpapiere bei der Festsetzung, der Zusammenstellung und der Kalkulation des The Dow Jones Industrial Average® zu berücksichtigen. Weder S&P Dow Jones Indices LLC. noch irgendeiner der Lizenzgeber ist verantwortlich für oder beteiligt sich an der Festsetzung des Zeitpunktes, des Preises oder der Anzahl der zu begebenden Wertpapiere noch an der Festsetzung oder der Berechnung der Formel, nach der die Wertpapiere einzulösen sind. Weder S&P Dow Jones Indices LLC. noch einer der

Lizenzgeber treffen Verpflichtungen oder Haftungen im Zusammenhang mit der Administration, dem Marketing oder dem Handel der Wertpapiere.

Der Dow Jones Industrial Average® ist ein Produkt von S&P Dow Jones Indices LLC ("SPDJI"), und wurde zur Verwendung an BNP Paribas S.A. und an jede von BNP Paribas S.A. gehaltene Tochtergesellschaft lizenziert. Standard & Poor's® und S&P® sind eingetragene Handelsmarken von Standard & Poor's Financial Services LLC ("S&P"); Dow Jones® ist eine eingetragene Handelsmarke von Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones"); und diese Handelsmarke wurde an SPDJI zur Nutzung und für bestimmte Zwecke zur Unterlizenenzierung lizenziert. Die Wertpapiere des Lizenznehmers werden von SPDJI, Dow Jones, S&P, und ihren jeweiligen verbundenen Unternehmen weder gesponsert, unterstützt, verkauft oder vertrieben und keine dieser Parteien nimmt Stellung dazu, ob eine Anlage in die Wertpapiere anzuraten ist. Der Lizenzgeber übernimmt keine Haftung für Fehler in den Berechnungen, Auslassungen oder Unterbrechungen in der Berechnung des Dow Jones Industrial Average®.

S&P DOW JONES INDICES GARANTIERT NICHT DIE ANGEMESSENHEIT, DIE GENAUIGKEIT, DIE AKTUALITÄT UND/ODER DIE VOLLSTÄNDIGKEIT DES INDEX ODER DER DARIN ENTHALTENEN DATEN ODER KOMMUNIKATION, EINSCHLIEßLICH ABER NICHT ABSCHLIEßEND MÜNDLICHE ODER SCHRIFTLICHE KOMMUNIKATION (EINSCHLIEßLICH ELEKTRONISCHER KOMMUNIKATION). S&P DOW JONES INDICES ÜBERNIMMT KEINE GEWÄHRLEISTUNG FÜR ETWAIGE FEHLER, AUSLASSUNGEN ODER UNTERBRECHUNGEN. S&P DOW JONES INDICES ÜBERNIMMT KEINERLEI GEWÄHRLEISTUNG, WEDER AUSDRÜCKLICH NOCH IMPLIZIT UND NIMMT AUSDRÜCKLICH ABSTAND VON JEGLICHER HAFTUNG HINSICHTLICH DER MARKTGÄNGIGKEIT ODER GEEIGNETHEIT FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG ODER ERGEBNISSE, DIE VON BNP PARBIBAS S.A. ODER EINER IHRER TOCHTERGESELLSCHAFTEN, DEN INHABERN DER WERTPAPIERE, ODER IRGENDEINER ANDEREN PERSON ODER EINHEIT AUS DEM GEBRAUCH DES INDEX DER DARIN ENTHALTENEN DATEN ERZIELT WERDEN SOLLEN. OHNE EINSCHRÄNKUNG DES VORGENANNTEN, ÜBERNIMMT S&P DOW JONES INDICES KEINE HAFTUNG FÜR ENTGANGENE GEWINNE ODER INDIREKTE, STRAFWEISE FESTGESETZTE, SPEZIELLE ODER FOLGESCHÄDEN ODER VERLUSTE, HANDELSVERLUSTE, ZEITLICHE VERLUSTE ODER VERLUSTE DES GOODWILL, SELBST WENN SIE VON DEREN MÖGLICHKEIT VERSTÄNDIGT WURDEN, GLEICH OB AUS VERTRÄGLICHER, DELIKTISCHER ODER VERSCHULDENSUNABHÄNGIGER ODER ANDERER HAFTUNG. AUSSER DEM LIZENZGEBER GIBT ES KEINEN DRITTEL BEGÜNSTIGTEN AUS IRGENDWELCHEN VERTRÄGEN ODER VEREINBARUNGEN ZWISCHEN S&P DOW JONES INDICES UND BNP PARBIBAS S.A. ODER EINER IHRER TOCHTERGESELLSCHAFTEN.

## ENDGÜLTIGE WERTPAPIERBEDINGUNGEN

Der für die Wertpapiere geltende Abschnitt A, unterteilt in Teil I, § 1 (Produktspezifische Bedingungen) und Teil II, §§ 2 und 3 (Basiswertspezifische Bedingungen) der Endgültigen Wertpapierbedingungen ist nachfolgend aufgeführt. Der für die Wertpapiere geltende Abschnitt B der Endgültigen Wertpapierbedingungen ist dem Abschnitt B, §§ 4-11 (Allgemeine Bedingungen) der Wertpapierbedingungen des Basisprospekts zu entnehmen.

### **Abschnitt A, Teil I (Produktspezifische Bedingungen):**

Die Inhaber-Sammelurkunde verbrieft mehrere Wertpapiere ("**Serienemission**"), die sich lediglich in der wirtschaftlichen Ausgestaltung des in § 1 gewährten Wertpapierrechts unterscheiden. Die unterschiedlichen Ausstattungsmerkmale je Wertpapier sind in der Tabelle am Ende des § 1 dargestellt und der einzelnen Emission von Wertpapieren zugewiesen. Die nachfolgenden Wertpapierbedingungen finden daher in Bezug auf jedes Wertpapier einer Serienemission nach Maßgabe dieser Tabelle entsprechend Anwendung.

### **§ 1**

#### **Wertpapierrecht, Definitionen**

- (1) BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH, Frankfurt am Main, ("**Emittentin**") gewährt jedem Inhaber ("**Wertpapierinhaber**") eines **Capped Bonus / Capped Bonus<sup>PRO</sup> Zertifikats** ("**Wertpapier**" und zusammen die "**Wertpapiere**") bezogen auf den Basiswert ("**Basiswert**"), der in der am Ende dieses § 1 dargestellten Tabelle aufgeführt ist, das Recht ("**Wertpapierrecht**"), von der Emittentin nach Maßgabe dieser Wertpapierbedingungen Zahlung des in Absatz (2) bezeichneten Auszahlungsbetrages in EUR ("**Auszahlungswährung**") gemäß § 1 und § 5 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) zu verlangen.
- (2) Der Auszahlungsbetrag ("**Auszahlungsbetrag**") ist der in der Referenzwährung bestimmte Maßgebliche Betrag ("**Maßgeblicher Betrag**"), der wie folgt ermittelt wird:
  - (a) Wenn **kein** Barrieren-Ereignis eingetreten ist, wird die Emittentin nach dem Bewertungstag einen Auszahlungsbetrag pro Wertpapier bestimmen, der ermittelt wird aus der Multiplikation (i) **entweder** des BonusLevels **oder, falls höher**, des Referenzpreises (ii) mit dem Bezugsverhältnis, **maximal** jedoch entspricht er dem Höchstbetrag, der sich aus der Multiplikation des Caps mit dem Bezugsverhältnis ergibt:
$$\text{MIN}(\text{MAX}(\text{BonusLevel}; \text{Referenzpreis}); \text{Cap}) \times \mathbf{B}$$
  - (b) Wenn **ein** Barrieren-Ereignis eingetreten ist, wird die Emittentin nach dem Bewertungstag einen Auszahlungsbetrag pro Wertpapier bestimmen, der ermittelt wird aus der Multiplikation des Referenzpreises mit dem Bezugsverhältnis, **maximal** jedoch entspricht er dem Höchstbetrag, der sich aus der Multiplikation des Caps mit dem Bezugsverhältnis ergibt:
$$\text{MIN}(\text{Referenzpreis}; \text{Cap}) \times \mathbf{B}$$

Es erfolgt eine Kaufmännische Rundung des so ermittelten Maßgeblichen Betrages auf die zweite Nachkommastelle.

Der Maßgebliche Betrag wird nach Maßgabe von § 1 Absatz (4) in die Auszahlungswährung umgerechnet, sofern die Referenzwährung nicht der Auszahlungswährung entspricht.

Ist der Maßgebliche Betrag null (0), entspricht der Auszahlungsbetrag lediglich 1/10 Eurocent pro Wertpapier ("**Mindestbetrag**"). Bei der Zahlung des Mindestbetrages erfolgt eine Kaufmännische Rundung.

Die Emittentin wird am Fälligkeitstag den Auszahlungsbetrag an den Wertpapierinhaber zahlen.

- (3) Im Sinne dieser Wertpapierbedingungen bedeutet:

**"Bankgeschäftstag"**: ist

- (a) jeder Tag (außer Samstag und Sonntag), an dem die Banken in Frankfurt am Main, in Wien und die CBF für den allgemeinen Geschäftsbetrieb geöffnet sind, und
- (b) im Zusammenhang mit Zahlungsvorgängen in EUR jeder Tag (außer Samstag und Sonntag), an dem das

Trans-European Automated Real-Time Gross Settlement Express Transfer-Zahlungssystem (TARGET-System) geöffnet ist.

**"Barriere"**: ist die dem Wertpapier in der am Ende des §1 stehenden Tabelle zugewiesene Barriere.

**"Barrienen-Ereignis"**: ist das Ereignis, wenn der Beobachtungskurs während des Beobachtungszeitraums die Barriere erreicht oder unterschreitet.

**"Basiswert"**: ist der dem Wertpapier in der am Ende des §1 stehenden Tabelle als Basiswert zugewiesene Wert.

Für die Zwecke dieser Wertpapierbedingungen entspricht ein Indexpunkt einer Währungseinheit der jeweiligen Referenzwährung.

**"Beobachtungskurs"**: ist jeder innerhalb des Beobachtungszeitraums von der Referenzstelle als offizieller Kurs festgestellte und veröffentlichte Kurs des Basiswerts beginnend mit dem ersten offiziell festgestellten Kurs zum Beginn des Beobachtungszeitraums.

**"Beobachtungszeitraum"**: ist der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle dem jeweiligen Wertpapier als Beobachtungszeitraum zugewiesene Zeitraum.

Der Beobachtungszeitraum beginnt zu dem Zeitpunkt, an dem der erste unter Beobachtungskurs definierte Kurs vorliegt, und endet mit der Feststellung des Referenzpreises (einschließlich).

Für den Beginn des Beobachtungszeitraums gilt § 3 entsprechend.

**"Berechnungsstelle"**: ist BNP Paribas Arbitrage S.N.C., 1 rue Laffitte, 75009 Paris, Frankreich.

**"Bewertungstag"**: ist der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Bewertungstag.

Wenn der Referenzpreis der Final Cash Settlement Price ist und der Bewertungstag auf den letzten Handelstag für Optionskontrakte bezogen auf den Basiswert vor einem Verfalltermin für diese Optionskontrakte fällt und dieser Tag kein Handelstag ist, gilt die entsprechende Regelung der Terminbörse (z.B. Vorverlegung bei Feiertagen).

Im Falle einer Marktstörung im Sinne des § 3 wird der Bewertungstag **maximal** um acht Handelstage verschoben.

**"Bezugsverhältnis" ("B")**: ist das dem Wertpapier in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene und als Dezimalzahl ausgedrückte Bezugsverhältnis.

**"BonusLevel"**: ist der dem Wertpapier in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene BonusLevel.

**"Cap"**: ist der dem Wertpapier in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Cap.

**"CBF"**: ist die Clearstream Banking AG Frankfurt (Mergenthalerallee 61, D-65760 Eschborn, Bundesrepublik Deutschland) oder ihre Nachfolgerin.

**"Final Cash Settlement Price"**: ist für den The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index) der am Bewertungstag unter Berücksichtigung eines Multiplikators von der Terminbörse festgestellte und veröffentlichte Settlement Price (Dow Jones (DJS)) für die auf den Basiswert bezogenen Optionskontrakte-und/oder Terminkontrakte. Maßgebend für diesen Preis sind die an der/den Hauptbörse(n) am Bewertungstag festgestellten Eröffnungskurse (Special Opening Quotation (SOQ)) bzw. die am vorhergehenden Handelstag dort zuletzt gehandelten Kurse der im Index enthaltenen Indexbestandteile.

**"Fälligkeitstag"**: ist der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Fälligkeitstag (bzw. falls dieser Tag kein Bankgeschäftstag ist, der nächste unmittelbar nachfolgende Bankgeschäftstag); oder, falls ein späterer Tag, spätestens der vierte Bankgeschäftstag nach dem Bewertungstag.

**"Handelstag"**: ist jeder Tag, an dem im Hinblick auf den Basiswert

- (a) die Referenzstelle, die Terminbörse und die Indexbörse für den regulären Handel geöffnet sind, und
- (b) der Kurs des Basiswerts durch die Referenzstelle festgestellt wird.

**"Indexbestandteile"**: sind die dem Basiswert zugrundeliegenden Werte.

**"Indexbörse"**: sind die Wertpapierbörsen/Handelssysteme, an denen die Indexbestandteile gehandelt werden, die in den Index einbezogen sind und von der Referenzstelle zur Berechnung des Index herangezogen werden.

**"Kaufmännische Rundung"**: ist der Vorgang des Abrundens oder Aufrundens. Wenn die Ziffer an der ersten wegfällenden Nachkommastelle eine 1, 2, 3 oder 4 ist, dann wird abgerundet. Ist die Ziffer an der ersten wegfällenden Nachkommastelle eine 5, 6, 7, 8 oder 9, dann wird aufgerundet.

**"Referenzpreis"**: ist der am Bewertungstag unter Berücksichtigung eines Multiplikators von der Terminbörse festgestellte und veröffentlichte Final Cash Settlement Price bezogen auf den Basiswert The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index).

Sollte der Referenzpreis am Bewertungstag nicht festgestellt werden und liegt keine Marktstörung gemäß § 3 vor, dann findet die für den Bewertungstag vorgesehene Regelung Anwendung.

Bei der Bestimmung des Referenzpreises entspricht ein Indexpunkt einer Währungseinheit der jeweiligen Referenzwährung, die, in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle, dem jeweiligen Wertpapier zugewiesen ist.

**"Referenzstelle"**: ist die dem Basiswert in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Referenzstelle.

**"Referenzwährung"**: ist die dem Basiswert in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Referenzwährung.

**"Terminbörse"**: ist die dem Basiswert in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Terminbörse.

(4) Die nachfolgenden Bestimmungen zur Währungsumrechnung finden dann Anwendung, wenn die dem Basiswert zugeordnete Referenzwährung nicht der Auszahlungswährung entspricht.

Für die Umrechnung von der Referenzwährung in die Auszahlungswährung wird die Berechnungsstelle den *am International Interbank Spot Market* tatsächlich gehandelten Kurs zugrundelegen und die Umrechnung auf Grundlage dieses Währungswechselkurses vornehmen.

Produkt 2 (Capped Bonus / Capped Bonus<sup>PRO</sup> Zertifikate)

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörse**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GJ8, DE000PH5GJ89 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	22.500,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GJ9, DE000PH5GJ97 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	22.500,0000	48.000,0000	48.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKA, DE000PH5GKA8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	23.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKB, DE000PH5GKB6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	23.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKC, DE000PH5GKC4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	23.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKD, DE000PH5GKD2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	23.500,0000	29.800,0000	29.800,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörse**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GKE, DE000PH5GKE0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	23.500,0000	33.000,0000	33.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKF, DE000PH5GKF7 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	23.500,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKG, DE000PH5GKG5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	23.500,0000	48.000,0000	48.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKH, DE000PH5GKH3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.000,0000	28.200,0000	28.200,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKJ, DE000PH5GKJ9 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKK, DE000PH5GKK7 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKL, DE000PH5GKL5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörse**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GKM, DE000PH5GKM3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.000,0000	52.000,0000	52.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKN, DE000PH5GKN1 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.500,0000	29.800,0000	29.800,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKP, DE000PH5GKP6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.500,0000	33.000,0000	33.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKQ, DE000PH5GKQ4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.500,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKR, DE000PH5GKR2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.500,0000	48.000,0000	48.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKS, DE000PH5GKS0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.000,0000	28.200,0000	28.200,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKT, DE000PH5GKT8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörse**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GKU, DE000PH5GKU6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKV, DE000PH5GKV4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKW, DE000PH5GKW2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.000,0000	52.000,0000	52.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKX, DE000PH5GKX0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.500,0000	29.800,0000	29.800,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKY, DE000PH5GKY8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.500,0000	33.000,0000	33.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKZ, DE000PH5GKZ5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.500,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK0, DE000PH5GK03 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.500,0000	48.000,0000	48.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörse**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GK1, DE000PH5GK11 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	26.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK2, DE000PH5GK29 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	26.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK3, DE000PH5GK37 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	26.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK4, DE000PH5GK45 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	27.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK5, DE000PH5GK52 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	27.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK6, DE000PH5GK60 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	27.000,0000	48.000,0000	48.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK7, DE000PH5GK78 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	28.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörse**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GK8, DE000PH5GK86 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	28.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK9, DE000PH5GK94 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	28.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GLA, DE000PH5GLA6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	29.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GLB, DE000PH5GLB4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	29.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GLC, DE000PH5GLC2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	30.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GLD, DE000PH5GLD0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	31.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GLE, DE000PH5GLE8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	32.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 16.12.2022	16.12.2022/ 22.12.2022

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörse**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GLF, DE000PH5GLF5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	19.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLG, DE000PH5GLG3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	19.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLH, DE000PH5GLH1 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	20.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLJ, DE000PH5GLJ7 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	20.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLK, DE000PH5GLK5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	20.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLL, DE000PH5GLL3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	21.000,0000	29.800,0000	29.800,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLM, DE000PH5GLM1 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	21.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörse**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GLN, DE000PH5GLN9 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	21.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLP, DE000PH5GLP4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	22.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLQ, DE000PH5GLQ2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	22.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLR, DE000PH5GLR0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	22.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLS, DE000PH5GLS8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	23.000,0000	29.800,0000	29.800,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLT, DE000PH5GLT6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	23.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLU, DE000PH5GLU4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	23.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörse**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GLV, DE000PH5GLV2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	23.000,0000	48.000,0000	48.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLW, DE000PH5GLW0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.000,0000	28.200,0000	28.200,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLX, DE000PH5GLX8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLY, DE000PH5GLY6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLZ, DE000PH5GLZ3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL0, DE000PH5GL02 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	24.000,0000	52.000,0000	52.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL1, DE000PH5GL10 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.000,0000	29.800,0000	29.800,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörse**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GL2, DE000PH5GL28 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL3, DE000PH5GL36 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL4, DE000PH5GL44 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	25.000,0000	48.000,0000	48.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL5, DE000PH5GL51 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	26.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL6, DE000PH5GL69 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	26.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL7, DE000PH5GL77 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	26.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL8, DE000PH5GL85 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	27.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörse**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GL9, DE000PH5GL93 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	27.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GMA, DE000PH5GMA4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	27.000,0000	48.000,0000	48.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GMB, DE000PH5GMB2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	28.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GMC, DE000PH5GMC0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	28.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GMD, DE000PH5GMD8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	28.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GME, DE000PH5GME6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	30.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GMF, DE000PH5GMF3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	32.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 20.01.2023	20.01.2023/ 26.01.2023

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Typ*	Referenz-währung*	Referenz-stelle*	Terminbörsen**	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Beobachtungs-zeitraum* Beginn/ Ende	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GMG, DE000PH5GMG1 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	18.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	24.09.2021 / 16.06.2023	16.06.2023/ 22.06.2023
PH5GMH, DE000PH5GMH9 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	19.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	24.09.2021 / 16.06.2023	16.06.2023/ 22.06.2023
PH5GMJ, DE000PH5GMJ5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	19.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	24.09.2021 / 16.06.2023	16.06.2023/ 22.06.2023
PH5GMK, DE000PH5GMK3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	Classic	USD	S&P Dow Jones Indices LLC	CBOE (Chicago Board Options Exchange)	0,01	20.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	24.09.2021 / 16.06.2023	16.06.2023/ 22.06.2023

\* Zur Klarstellung gelten alle Angaben vorbehaltlich der Bestimmungen zu Anpassungen bzw. der sonstigen Bestimmungen der Wertpapierbedingungen

\*\* bzw. die jeweilige Hauptterminbörse, an der Termin- oder Optionskontrakte in Bezug auf den Basiswert gehandelt werden

Bei den verwendeten Abkürzungen für die jeweilige Währung handelt es sich (mit Ausnahme der Abkürzung "GBp", die für Britische Pence Sterling steht und wobei GBp 100 einem Britischen Pfund Sterling ("GBP" 1,00) entsprechen) um die offiziell verwendeten ISO-Währungskürzel. ISO = International Organization for Standardization; Währungskürzel zurzeit auch auf der Internetseite: <http://publications.europa.eu/code/de/de-5000700.htm>

## **Abschnitt A, Teil II (Basiswertspezifische Bedingungen):**

### **§ 2**

#### **Anpassungen, außerordentliche Kündigung**

- (1) Wird der als Basiswert verwendete Index nicht mehr von der Referenzstelle, sondern von einer anderen Person, Gesellschaft oder Institution, die die Berechnungsstelle für geeignet hält ("Nachfolge-Referenzstelle") berechnet und veröffentlicht, so wird der maßgebliche Kurs gegebenenfalls auf der Grundlage des von der Nachfolge-Referenzstelle berechneten und veröffentlichten Index bestimmt. Jede in diesen Wertpapierbedingungen enthaltene Bezugnahme auf die Referenzstelle gilt, sofern es der Zusammenhang erlaubt, als Bezugnahme auf die Nachfolge-Referenzstelle.
- (2) Wird der Index zu irgendeiner Zeit aufgehoben und/oder durch einen anderen Index ersetzt, der nach Feststellung der Berechnungsstelle nach derselben oder einer vergleichbaren Formel und Art und Weise wie der bisherige Index berechnet und zusammengestellt wird, so ist dieser Index für die Berechnung des Auszahlungsbetrages zugrunde zu legen ("Nachfolge-Index"). Der Nachfolge-Index sowie der Zeitpunkt seiner erstmaligen Anwendung werden unverzüglich gemäß § 9 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekannt gemacht. Jede in diesen Wertpapierbedingungen enthaltene Bezugnahme auf den Index gilt dann, sofern es der Zusammenhang erlaubt, als Bezugnahme auf den Nachfolge-Index.
- (3) Wenn:
- (a) der Index dauerhaft oder vorübergehend aufgehoben wird,
  - (b) die Formel und Art und Weise der bisherigen Berechnung oder die Zusammenstellung des Index von der Referenzstelle so geändert wird, dass der Index nach Feststellung der Berechnungsstelle nicht mehr mit dem bisherigen Index vergleichbar ist,
  - (c) der Index von der Referenzstelle durch einen Index ersetzt wird, der nach Feststellung der Berechnungsstelle im Hinblick auf die Berechnungsmethode oder Zusammenstellung nicht mehr mit dem bisherigen Index vergleichbar ist,
  - (d) die Referenzstelle nach Feststellung der Berechnungsstelle nicht in der Lage ist, die Berechnung des Index vorzunehmen, ausgenommen aus Gründen, die zugleich eine Marktstörung gemäß § 3 darstellen, oder
  - (e) andere als die vorstehend bezeichneten Ereignisse eintreten, die nach Auffassung der Emittentin und der Berechnungsstelle nach billigem Ermessen in ihren wirtschaftlichen Auswirkungen diesen Ereignissen vergleichbar sind und die Einfluss auf den rechnerischen Wert des Index haben können,
- (jeweils ein "Anpassungsereignis") wird die Emittentin, sofern die Wertpapiere nicht nach Absatz (4) gekündigt wurden, die Wertpapierbedingungen in der Weise anpassen, dass die Wertpapierinhaber wirtschaftlich soweit wie möglich so gestellt werden, wie sie vor Durchführung der Maßnahmen und/oder Eintritt der Ereignisse nach Absatz (3) standen. Bei der Berechnung des relevanten Kurses des Index wird die Berechnungsstelle diejenige Berechnungsmethode anwenden, welche die Referenzstelle unmittelbar vor der Änderung oder Einstellung des Index verwendet hat und zwar nur auf der Basis der Indexbestandteile, die dem Index unmittelbar vor dessen Änderung oder Einstellung zugrunde lagen, mit Ausnahme von Veränderungen, die im Rahmen der Berechnungsmethode zur Bestimmung des Index für den Fall der Veränderung der Zusammensetzung der Indexbestandteile vorgesehen waren. Die Emittentin wird eine Fortführung der Indexberechnung unverzüglich gemäß § 9 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekannt machen.
- (4) Die Emittentin ist berechtigt, aber nicht verpflichtet, die Wertpapiere im Falle eines Anpassungsereignisses außerordentlich durch Bekanntmachung gemäß § 9 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) zu kündigen. Im Falle einer Kündigung zahlt die Emittentin anstatt der unter den Wertpapieren ansonsten zu leistenden Zahlungen an jeden Wertpapierinhaber einen Betrag je Wertpapier ("Kündigungsbetrag"), der von der Berechnungsstelle nach billigem Ermessen (§ 317 BGB) als angemessener Marktpreis des Wertpapiers unmittelbar vor dem zur Kündigung berechtigenden Ereignis festgelegt wird.
- Die Emittentin wird den Kündigungsbetrag innerhalb von vier Bankgeschäftstagen nach dem Tag der Bekanntmachung gemäß § 9 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) an die CBF oder ihre Nachfolgerin zur Weiterleitung an die Wertpapierinhaber überweisen. Die Emittentin wird den Kündigungsbetrag gemäß § 5 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) zahlen.
- (5) Berechnungen, Entscheidungen und Feststellungen nach den vorstehenden Absätzen werden durch die Berechnungsstelle (§ 8 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen)) für die Emittentin vorgenommen und sind für alle Beteiligten bindend, sofern nicht ein offensichtlicher Fehler vorliegt. Sämtliche Anpassungen sowie der Zeitpunkt ihres Inkrafttretens werden unverzüglich nach § 9 in Abschnitt B der

Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekannt gemacht.

(6) Bei dem Basiswert handelt es sich um einen Referenzwert im Sinne der Verordnung (EU) 2016/1011 des Europäischen Parlaments und des Rates ("ReferenzwertVO"). Daher gilt zusätzlich:

Wenn der Basiswert (der "Referenzwert") nach Feststellung der Berechnungsstelle aufgrund gesetzlicher oder behördlicher Vorgaben nicht mehr verwendet werden kann, insbesondere:

- (i) bei Vorliegen eines "**Nichtgenehmigungssereignisses**": wenn eine Zulassung, Registrierung, Anerkennung, Übernahme, ein Beschluss über die Gleichwertigkeit oder eine Genehmigung in Bezug auf einen Referenzwert oder dessen Administrator nicht erteilt wurde oder nicht erteilt wird, der Referenzwert oder dessen Administrator nicht in dem Register nach Art. 36 ReferenzwertVO eingetragen wurde oder eingetragen wird oder der Referenzwert oder dessen Administrator gesetzliche oder regulatorische Anforderungen im Hinblick auf die Wertpapiere, die Emittentin, die Berechnungsstelle oder den Referenzwert nicht erfüllt;  
ein Nichtgenehmigungssereignis liegt nicht vor, wenn der Referenzwert oder dessen Administrator nicht in ein offizielles Register aufgenommen ist oder wird, weil seine Zulassung, Registrierung, Anerkennung, Übernahme, ein Beschluss über die Gleichwertigkeit oder eine Genehmigung ausgesetzt wird, sofern zum Zeitpunkt der Aussetzung die weitere Bereitstellung und Verwendung des Referenzwerts im Hinblick auf die Wertpapiere während dieser Aussetzung unter den anwendbaren Gesetzen und Vorschriften erlaubt ist;
- (ii) bei Vorliegen eines "**Ablehnungssereignisses**": wenn die relevante zuständige Behörde oder eine andere relevante offizielle Stelle im Hinblick auf die Wertpapiere, den Referenzwert oder dessen Administrator einen erforderlichen Antrag für die Zulassung, Registrierung, Anerkennung, Übernahme, einen Beschluss über die Gleichwertigkeit, eine Genehmigung oder die Aufnahme in das Register nach Art. 36 ReferenzwertVO, die nach sämtlichen für die Emittentin, die Berechnungsstelle oder sonstige Einheit anwendbaren Gesetzen und Vorschriften erforderlich sind, um die Verpflichtungen im Hinblick auf die Wertpapiere zu erfüllen, ablehnt oder verweigert oder ablehnen oder verweigern wird oder
- (iii) bei Vorliegen eines "**Aussetzungs- oder Widerrufssereignisses**": wenn die jeweilige zuständige Behörde oder eine andere relevante offizielle Stelle eine Zulassung, Registrierung, Anerkennung, Übernahme, einen Beschluss über die Gleichwertigkeit oder eine Genehmigung in Bezug auf den Referenzwert oder dessen Administrator, die nach sämtlichen für die Emittentin, die Berechnungsstelle oder sonstige Einheit anwendbaren Gesetzen und Vorschriften erforderlich sind, um die Verpflichtungen im Hinblick auf die Wertpapiere zu erfüllen, aussetzt oder widerruft oder aussetzen oder widerrufen wird oder der Referenzwert oder dessen Administrator nicht in ein Register nach Art. 36 ReferenzwertVO aufgenommen wird oder die Aufnahme widerrufen wurde, sofern eine Aufnahme in dieses Register unter dem jeweils geltend Recht erforderlich ist oder erforderlich sein wird, um die Verpflichtungen der Emittentin, der Berechnungsstelle oder einer sonstigen Einheit im Hinblick auf die Wertpapiere zu erfüllen;  
ein Aussetzungs- oder Widerrufssereignis liegt nicht vor, sofern eine Zulassung, Registrierung, Anerkennung, Übernahme, ein Beschluss über die Gleichwertigkeit oder eine Genehmigung ausgesetzt oder widerrufen wird oder die Aufnahme in ein offizielles Register widerrufen wird, sofern zum Zeitpunkt der Aussetzung oder des Widerrufs die weitere Bereitstellung und Verwendung des Referenzwerts im Hinblick auf die Wertpapiere während dieser Aussetzung oder dieses Widerrufs unter den anwendbaren Gesetzen und Vorschriften erlaubt ist;

(jeweils ein "**Potenzielles Anpassungssereignis**") finden die Regelungen der Absätze (1) bis (5) hinsichtlich einer Anpassung bzw. eines Anpassungssereignisses entsprechende Anwendung. Insbesondere kann die Emittentin bzw. die Berechnungsstelle einen Nachfolge-Index bzw. eine Nachfolge-Referenzstelle bestimmen oder die Wertpapiere anpassen oder außerordentlich kündigen.

### § 3

#### Marktstörungen

- (1)
- (a) In Abweichung von Absatz (1)(b), wenn nach Auffassung der Berechnungsstelle zum Zeitpunkt der Feststellung des maßgeblichen Kurses eine Marktstörung, wie in Absatz (2) definiert, vorliegt, wird der betroffene Tag, vorbehaltlich des letzten Absatzes dieses § 3, auf den unmittelbar nachfolgenden Handelstag, an dem keine Marktstörung mehr vorliegt, verschoben. Bei einer Verschiebung des Bewertungstages wird der Fälligkeitstag entsprechend angepasst.
  - (b) Wenn während des Beobachtungszeitraums eine Marktstörung vorliegt, kann die Berechnungsstelle nach

billigem Ermessen (§ 317 BGB) während der Dauer dieser Marktstörung entweder die Feststellung des Beobachtungskurses aussetzen, oder anstelle des Beobachtungskurses einen von ihr auf Basis der dann geltenden Marktusancen und unter Berücksichtigung der dann herrschenden Marktgegebenheiten zu bestimmenden Ersatz-Kurs des Basiswerts zur Feststellung eines Barrieren-Ereignisses heranziehen.

(2) In Bezug auf einen Index als Basiswert bedeutet "**Marktstörung**":

- (a) die Suspendierung oder wesentliche Einschränkung des Handels (i) der im Index enthaltenen Indexbestandteile an der Indexbörsen, sofern diese Indexbestandteile mindestens 20 % der Börsenkapitalisierung aller Indexbestandteile darstellen, die jeweils im Index einbezogen sind oder (ii) von auf den Index bezogenen Terminkontrakten oder Optionskontrakten an der Terminbörsen;
- (b) ein Ereignis, das die Möglichkeit von Marktteilnehmern unterbricht oder beeinträchtigt, (i) Geschäfte in Indexbestandteilen zu tätigen, die mindestens 20 % der Börsenkapitalisierung aller Indexbestandteile darstellen, oder Marktpreise für diese Indexbestandteile zu erhalten, oder (ii) Geschäfte in von auf den Index bezogenen Terminkontrakten oder Optionskontrakten an der Terminbörsen zu tätigen;
- (c) dass die Indexbörsen in Bezug auf Indexbestandteile, die mindestens 20 % der Börsenkapitalisierung aller Indexbestandteile darstellen, oder die Terminbörsen vor ihrem regulären Handelsschluss schließen. Das gilt nicht, wenn die Indexbörsen oder Terminbörsen den Handelsschluss mindestens eine Stunde vor dem tatsächlichen Handelsschluss oder, wenn dieser Zeitpunkt früher liegt, dem letzten Zeitpunkt für die Ordereingabe bei der Indexbörsen oder Terminbörsen zur Ausführung zum Bewertungszeitpunkt an dem betreffenden Handelstag ankündigt; oder
- (d) wenn die Wertentwicklung des Index von der Wertentwicklung von auf den Index bezogenen Terminkontrakten oder Optionskontrakten, die als Absicherungsinstrumente dienen, um mehr als 0,5 % abweicht.

(3) Wenn der Bewertungstag um mehr als die in der Definition von Bewertungstag gemäß § 1 genannte Anzahl von Handelstagen nach Ablauf des ursprünglichen Tages verschoben worden ist und auch an diesem Tag die Marktstörung fortbesteht, dann gilt dieser Tag als Bewertungstag.

Der für die Ermittlung des maßgeblichen Kurses verwendete Kurs des Index als Basiswert entspricht dann dem von der Berechnungsstelle bestimmten Kurs, durch Zugrundelegung der Berechnungsweise und -methode des Index, die unmittelbar vor Eintritt der Marktstörung galten (der "**Ermittlungszeitpunkt**"). Dabei wird die Berechnungsstelle die Indexbestandteile mit dem an der Indexbörsen am ursprünglich festgelegten, nicht verschobenen Tag zu dem für den Ermittlungszeitpunkt definierten Kurs bewerten. Sofern die Marktstörung darauf beruht, dass eine Marktstörung in Bezug auf einen einzelnen Indexbestandteil aufgetreten ist, so wird die Berechnungsstelle den Kurs des betroffenen Indexbestandteiles nach billigem Ermessen (§ 317 BGB) bestimmen.

## Weitere Informationen

### Verwendung des Emissionserlöses:

#### **Zweckbestimmung des Emissionserlöses**

Die Emittentin wird den Nettoerlös der Emission ausschließlich zur Absicherung ihrer Verbindlichkeiten gegenüber den Wertpapierinhabern unter den Wertpapieren verwenden.

### Zulassung der Wertpapiere zum Handel:

#### **Börsennotierung und Zulassung zum Handel**

Die Beantragung der Einbeziehung der Wertpapiere in den Freiverkehr der Frankfurter Börse und der Börse Stuttgart ist beabsichtigt. Die Einbeziehung der Wertpapiere in den Handel ist (frühestens) für den 24. September 2021 geplant.

### Angebotskonditionen:

#### **Angebotsfrist**

Vom 24. September 2021 bis zum Ablauf der Gültigkeit des Prospekts bzw. des jeweils aktuellen Basisprospekts.

Der Basisprospekt vom 19. Februar 2021 verliert am 19. Februar 2022 seine Gültigkeit. Ab diesem Zeitpunkt sind die Endgültigen Angebotsbedingungen für diejenigen Wertpapiere, deren Laufzeit bis zum 19. Februar 2022 nicht beendet worden ist, im Zusammenhang mit dem jeweils aktuellen Basisprospekt der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH, Frankfurt am Main, zur Neuemission sowie zur Fortsetzung des öffentlichen Angebots und zur Erhöhung des Emissionsvolumens von Zertifikaten, Aktienanleihen, Anleihen zu lesen, der dem Basisprospekt vom 19. Februar 2021 nachfolgt.

Die Emittentin behält sich das Recht vor, die Emission der Wertpapiere ohne Angabe von Gründen nicht vorzunehmen.

#### **Vertriebsstellen**

Banken und Sparkassen

#### **Gegenpartei und Übernehmerin**

BNP Paribas Arbitrage S.N.C.

#### **Emissionswährung**

EUR

#### **Emissionstermin (Valutatag)**

28. September 2021

#### **Anfänglicher Ausgabepreis und Volumen je Serie**

Der anfängliche Ausgabepreis sowie das Volumen je Wertpapier der einzelnen Serien von Wertpapieren sind nachfolgender Tabelle zu entnehmen. Der anfängliche Ausgabepreis je Wertpapier bzw. je Wertpapier der einzelnen Serien von Wertpapieren enthält die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten produktsspezifischen Einstiegskosten.

Danach wird der Verkaufspreis von BNP Paribas Arbitrage S.N.C. fortlaufend festgesetzt.

Die Emittentin behält sich eine Aufstockung des Emissionsvolumens vor.

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Im Anfänglichen Ausgabepreis enthaltene produktsspezifische Einstiegskosten (zum Datum dieser Endgültigen Angebotsbedingungen)	Volumen
DE000PH5GJ89	317,16	4,076	50.000
DE000PH5GJ97	375,56	5,544	50.000
DE000PH5GKA8	253,68	2,578	50.000
DE000PH5GKB6	287,11	3,399	50.000
DE000PH5GKC4	344,79	4,937	50.000
DE000PH5GKD2	241,66	2,319	50.000
DE000PH5GKE0	264,84	2,873	50.000
DE000PH5GKF7	314,75	4,24	50.000

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Im Anfänglichen Ausgabepreis enthaltene produktspezifische Einstiegskosten (zum Datum dieser Endgültigen Angebotsbedingungen)	Volumen
DE000PH5GKG5	371,47	5,857	50.000
DE000PH5GKH3	229,77	2,07	50.000
DE000PH5GKJ9	252,93	2,604	50.000
DE000PH5GKK7	285,48	3,482	50.000
DE000PH5GKL5	341,35	5,166	50.000
DE000PH5GKM3	397,10	6,838	50.000
DE000PH5GKN1	241,20	2,336	50.000
DE000PH5GKP6	263,82	2,909	50.000
DE000PH5GKQ4	312,12	4,368	50.000
DE000PH5GKR2	366,84	6,151	50.000
DE000PH5GKS0	229,55	2,071	50.000
DE000PH5GKT8	252,24	2,618	50.000
DE000PH5GKU6	283,78	3,533	50.000
DE000PH5GKV4	337,44	5,358	50.000
DE000PH5GKW2	390,96	7,204	50.000
DE000PH5GKX0	240,82	2,335	50.000
DE000PH5GKY8	262,83	2,921	50.000
DE000PH5GKZ5	309,22	4,463	50.000
DE000PH5GK03	361,53	6,403	50.000
DE000PH5GK11	251,62	2,61	50.000
DE000PH5GK29	282,01	3,547	50.000
DE000PH5GK37	333,23	5,488	50.000
DE000PH5GK45	261,48	2,896	50.000
DE000PH5GK52	304,58	4,476	50.000
DE000PH5GK60	352,44	6,64	50.000
DE000PH5GK78	250,72	2,57	50.000
DE000PH5GK86	278,59	3,438	50.000
DE000PH5GK94	323,24	5,494	50.000
DE000PH5GLA6	260,14	2,803	50.000
DE000PH5GLB4	297,95	4,205	50.000
DE000PH5GLC2	275,73	3,181	50.000
DE000PH5GLD0	291,59	3,538	50.000
DE000PH5GLE8	273,96	2,891	50.000
DE000PH5GLF5	268,29	2,68	50.000
DE000PH5GLG3	322,60	3,635	50.000
DE000PH5GLH1	255,01	2,53	50.000
DE000PH5GLJ7	290,17	3,202	50.000
DE000PH5GLK5	351,20	4,415	50.000
DE000PH5GLL3	242,09	2,346	50.000
DE000PH5GLM1	266,21	2,839	50.000
DE000PH5GLN9	318,66	3,986	50.000
DE000PH5GLP4	253,35	2,637	50.000
DE000PH5GLQ2	287,19	3,43	50.000
DE000PH5GLR0	345,69	4,892	50.000

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Im Anfänglichen Ausgabepreis enthaltene produktspezifische Einstiegskosten (zum Datum dieser Endgültigen Angebotsbedingungen)	Volumen
DE000PH5GLS8	240,93	2,404	50.000
DE000PH5GLT6	264,10	2,964	50.000
DE000PH5GLU4	314,09	4,318	50.000
DE000PH5GLV2	370,91	5,925	50.000
DE000PH5GLW0	228,90	2,153	50.000
DE000PH5GLX8	251,80	2,696	50.000
DE000PH5GLY6	283,92	3,593	50.000
DE000PH5GLZ3	338,97	5,325	50.000
DE000PH5GL02	393,86	7,072	50.000
DE000PH5GL10	240,00	2,417	50.000
DE000PH5GL28	262,04	3,005	50.000
DE000PH5GL36	308,66	4,536	50.000
DE000PH5GL44	361,29	6,451	50.000
DE000PH5GL51	250,50	2,695	50.000
DE000PH5GL69	280,44	3,629	50.000
DE000PH5GL77	330,73	5,591	50.000
DE000PH5GL85	260,22	2,971	50.000
DE000PH5GL93	302,56	4,543	50.000
DE000PH5GMA4	349,39	6,717	50.000
DE000PH5GMB2	249,63	2,645	50.000
DE000PH5GMC0	277,07	3,496	50.000
DE000PH5GMD8	320,84	5,519	50.000
DE000PH5GME6	293,02	3,921	50.000
DE000PH5GMF3	272,72	2,958	50.000
DE000PH5GMG1	287,54	3,556	50.000
DE000PH5GMH9	263,57	3,177	50.000
DE000PH5GMJ5	315,94	4,348	50.000
DE000PH5GMK3	250,64	2,979	50.000

**Mitgliedstaat(en), für die die Verwendung des Prospekts durch den/die zugelassenen Anbieter gestattet ist**

Bundesrepublik Deutschland und Republik Österreich

**Angabe der Tranche, die für bestimmte Märkte vorbehalten ist, wenn die Wertpapiere gleichzeitig an den Märkten zweier oder mehrerer Staaten angeboten werden**

Entfällt

**Details (Namen und Adressen) zu Platzeur(en)**

Entfällt

**Verfahren für die Mitteilung des zugeteilten Betrags an die Antragsteller und Informationen dazu, ob bereits vor Erhalt der entsprechenden Mitteilung mit den Wertpapieren gehandelt werden darf**

Entfällt

**Weitere Angaben:**

**Anwendbarkeit der Quellenbesteuerung** Nein, zum Datum der Endgültigen Angebotsbedingungen.

**gemäß Abschnitt 871(m) des US  
Bundessteuergesetzes (Internal  
Revenue Code)**

**Erklärung bezüglich Artikel 29 (2) der  
EU Referenzwert Verordnung**

Unter diesen Wertpapieren zahlbare Beträge werden unter Bezugnahme auf die folgenden Referenzwerte berechnet, welche von den folgenden Administratoren zur Verfügung gestellt werden.

**Administrator**

**Referenzwert**

Zum Datum dieser Endgültigen Angebotsbedingungen ist der jeweilige Administrator ("Administrator") als Administrator im Register der Administratoren und Referenzwerte, welches von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (*European Securities and Markets Authority* - "ESMA") gemäß Artikel 36 der EU Referenzwert Verordnung erstellt und geführt wird, eingetragen.

S&P Dow Jones Indices LLC

The Dow Jones Industrial Average®  
Index (Kurs Index)

Ja

Aktuelle Informationen dazu, ob der jeweilige Administrator im Register der Administratoren und Referenzwerte eingetragen ist, sind zum Datum dieser Endgültigen Angebotsbedingungen auf der Internetseite der ESMA [www.esma.europa.eu/databases-library/registers-and-data](http://www.esma.europa.eu/databases-library/registers-and-data) veröffentlicht.

## Zusammenfassung

### Abschnitt A - Einleitung mit Warnhinweisen

#### Warnhinweise

- a) Die Zusammenfassung sollte als Einleitung zu dem Basisprospekt verstanden werden.
- b) Anleger sollten jede Entscheidung, in die betreffenden Wertpapiere zu investieren, auf den Basisprospekt als Ganzes stützen.
- c) Anleger könnten ihr gesamtes angelegtes Kapital (Totalverlust) oder einen Teil davon verlieren.
- d) Für den Fall, dass vor einem Gericht Ansprüche aufgrund der im Basisprospekt enthaltenen Informationen geltend gemacht werden, können als Kläger auftretende Anleger nach nationalem Recht die Kosten für die Übersetzung des Basisprospekts, einschließlich etwaiger Nachträge, sowie der dazugehörigen Endgültigen Bedingungen vor Prozessbeginn zu tragen haben.
- e) Die BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH (die "Emittentin"), die als Emittentin der Wertpapiere die Verantwortung für die Zusammenfassung einschließlich etwaiger Übersetzungen hieron übernommen hat oder die Personen, die die Zusammenfassung samt etwaiger Übersetzungen vorgelegt und übermittelt haben, haften zivilrechtlich, jedoch nur für den Fall, dass die Zusammenfassung, wenn sie zusammen mit den anderen Teilen des Basisprospekts gelesen wird, irreführend, unrichtig oder widersprüchlich ist oder dass sie, wenn sie zusammen mit den anderen Teilen des Basisprospekts gelesen wird, nicht die Basisinformationen vermittelt, die in Bezug auf Anlagen in die betreffenden Wertpapiere für die Anleger eine Entscheidungshilfe darstellen würden.
- f) **Anleger sind im Begriff, ein Produkt zu erwerben, das nicht einfach ist und schwer zu verstehen sein kann.**

#### Einleitende Angaben

<b>Bezeichnung und Wertpapierkennnummern:</b>	Capped Bonus / Capped Bonus <sup>PRO</sup> Zertifikate bezogen auf Indizes (die "Wertpapiere"), ISIN: / WKN: siehe Tabelle
<b>Identität und Kontaktdaten der Emittentin:</b>	Die Emittentin (mit der Rechtsträgerkennung (LEI): 549300TS3U4JKMR1B479) hat ihren eingetragenen Sitz in Europa-Allee 12, 60327 Frankfurt am Main, Bundesrepublik Deutschland. Telefonnummer: +49 (0) 69 7193 - 0
<b>Zuständige Behörde:</b>	Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht ("BaFin"). Die Geschäftssadresse der BaFin (Wertpapieraufsicht) lautet: Marie-Curie-Str. 24-28, 60439 Frankfurt, Bundesrepublik Deutschland. (Telefonnummer: +49 (0) 228 41080).
<b>Billigung des Basisprospekts:</b>	19. Februar 2021

### Abschnitt B - Basisinformationen über die Emittentin

#### Wer ist die Emittentin der Wertpapiere?

<b>Sitz und Rechtsform:</b>	Sitz der Emittentin ist Frankfurt am Main. Die Geschäftssadresse lautet: Europa-Allee 12, 60327 Frankfurt am Main, Bundesrepublik Deutschland. Die Emittentin ist eine Gesellschaft mit beschränkter Haftung gemäß deutschem Recht (mit der Rechtsträgerkennung (LEI): 549300TS3U4JKMR1B479).
<b>Haupttätigkeiten:</b>	Emission von Wertpapieren
<b>Hauptanteilseigner:</b>	Alleinige Gesellschafterin der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH ist BNP Paribas S.A., eine börsennotierte Aktiengesellschaft nach französischem Recht.
<b>Identität der Hauptgeschäftsführer:</b>	Geschäftsführer der Emittentin sind Grégoire Toublanc und Hans Eich.

#### Welches sind die wesentlichen Finanzinformationen über die Emittentin?

Die nachfolgenden Finanzinformationen sind den geprüften Jahresabschlüssen der Emittentin zum 31. Dezember 2019 und zum 31. Dezember 2020 entnommen.

**Tabelle 1: Gewinn- und Verlustrechnung – Nitchividendenwerte**

	<b>Jahresabschluss 31. Dezember 2020 in EUR</b>	<b>Jahresabschluss 31. Dezember 2019 in EUR</b>
<b>Ergebnis der gewöhnlichen Geschäftstätigkeit</b>		
Sonstige Betriebliche Erträge	525.572,67	1.130.112,99
Sonstige Betriebliche Aufwendungen	- 525.572,67	- 1.130.112,99
Jahresüberschuss	0	0

**Tabelle 2: Bilanz – Nitchividendenwerte**

	<b>Jahresabschluss 31. Dezember 2020 in EUR</b>	<b>Jahresabschluss 31. Dezember 2019 in EUR</b>
--	---	---

<b>Forderungen und sonstige Vermögensgegenstände</b>		
Forderungen gegen verbundene Unternehmen	82.133.636,23	120.695.281,45
Sonstige Vermögensgegenstände (Aktiva/Umlaufvermögen)	2.830.561.707,30	2.339.441.633,25
<b>Verbindlichkeiten</b>		
Anleihen (Passiva/Verbindlichkeiten)	1.664.491.487,06	1.578.897.172,19
Sonstige Verbindlichkeiten (Passiva/Verbindlichkeiten)	1.247.529.078,47	880.715.835,51
Nettofinanzverbindlichkeiten (langfristige Verbindlichkeiten plus kurzfristige Schulden abzüglich Barmittel)	0	0

**Tabelle 3: Kapitalflussrechnung – Nichtdividendenwerte**

	<b>Für den Zeitraum</b> <b>1. Januar bis 31. Dezember 2020</b> <b>in EUR</b>	<b>Für den Zeitraum</b> <b>1. Januar bis 31. Dezember 2019</b> <b>in EUR</b>
Netto-Cashflows aus der laufenden Geschäftstätigkeit	-282.391,36	-335.437,56
Netto-Cashflows aus Finanzierungstätigkeiten	0	0
Netto-Cashflow aus Investitionstätigkeiten	0	0

#### **Welches sind die zentralen Risiken, die für die Emittentin spezifisch sind?**

**Die Wertpapierinhaber tragen das Emittenten-/Bonitätsrisiko:** Wertpapierinhaber sind, vorbehaltlich der Garantie der BNP Paribas S.A. als Garantin für die ordnungsgemäße Zahlung von sämtlichen Beträgen, die nach Maßgabe der durch die Emittentin ausgegebenen Wertpapiere zahlbar sind, dem Risiko ausgesetzt, dass die Emittentin ihre Verpflichtungen aus den Wertpapieren nicht erfüllen kann, zum Beispiel im Falle einer Insolvenz (Zahlungsunfähigkeit / Überschuldung). Eine Insolvenz der Emittentin kann sogar zum vollständigen Verlust des Kapitalbetrags führen, den Wertpapierinhaber beim Kauf der Wertpapiere bezahlt haben (**Totalverlustrisiko**).

**Die Wertpapierinhaber tragen das Risiko der Nichterfüllung des Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrags:** Zwischen BNP Paribas S.A. und der Emittentin besteht ein Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrag. Danach ist die BNP Paribas S.A. insbesondere verpflichtet, jeden während der Vertragsdauer des Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrag sonst entstehenden Jahresfehlbetrag der Emittentin auszugleichen. Anleger, die in die von der Emittentin ausgegebenen Wertpapiere investiert haben, sind daher dem Risiko ausgesetzt, dass die Emittentin, sofern BNP Paribas S.A. ihre Verpflichtungen gegenüber der Emittentin unter dem Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrag nicht, nicht in vollem Umfang oder nicht rechtzeitig erfüllt, ihren Verpflichtungen gegenüber den Wertpapierinhaber nicht, nicht in vollem Umfang oder nicht rechtzeitig erfüllen kann. In diesem Fall können Wertpapierinhaber gegebenenfalls einen vollständigen Verlust des Kapitalbetrags erleiden, den Wertpapierinhaber beim Kauf der Wertpapiere bezahlt haben (**Totalverlustrisiko**).

#### **Abschnitt C – Basisinformationen über die Wertpapiere**

##### **Welches sind die wichtigsten Merkmale der Wertpapiere?**

###### **Art und Form der Wertpapiere**

Die Wertpapiere werden nach deutschem Recht in Form von Inhaberschuldverschreibungen im Sinne von § 793 BGB begeben. Die Wertpapiere sind frei übertragbar und unterliegen keinen Beschränkungen.

###### **Mit den Wertpapieren verbundene Rechte**

Die Wertpapiere werden nicht verzinst.

Die Wertpapiere gelten ohne weitere Voraussetzung am Bewertungstag als ausgeübt.

###### **Rückzahlung**

Durch die Wertpapiere hat der Wertpapierinhaber einen Anspruch auf Zahlung des Auszahlungsbetrages am Fälligkeitstag, wie nachfolgend beschrieben.

###### **Ertragsmodalitäten**

Die Zahlung des Auszahlungsbetrages in der Auszahlungswährung pro Wertpapier erfolgt spätestens am Fälligkeitstag an den Wertpapierinhaber.

Der Auszahlungsbetrag errechnet sich bei **Capped Bonus / Capped Bonus<sup>PRO</sup>** Zertifikaten

- (a) wenn kein Barrieren-Ereignis eingetreten ist, aus der Multiplikation (i) entweder des BonusLevels oder, falls höher, des Referenzpreises (ii) mit dem Bezugsverhältnis, maximal jedoch entspricht er dem Höchstbetrag der sich aus der Multiplikation des Caps mit dem Bezugsverhältnis ergibt;
- (b) wenn ein Barrieren-Ereignis eingetreten ist, aus der Multiplikation des Referenzpreises mit dem Bezugsverhältnis, maximal jedoch entspricht er dem Höchstbetrag, der sich aus der Multiplikation des Caps mit dem Bezugsverhältnis ergibt.

Ist der maßgebliche Betrag null (0) oder rechnerisch negativ, entspricht der Auszahlungsbetrag lediglich 1/10 Eurocent pro Wertpapier (Mindestbetrag).

###### **Beschränkung der mit den Wertpapieren verbundenen Rechte**

Die Emittentin ist unter bestimmten Voraussetzungen zur Anpassung der Wertpapierbedingungen berechtigt.

Darüber hinaus kann die Emittentin berechtigt sein, bei Vorliegen eines Anpassungereignisses in Bezug auf den Basiswert, die Wertpapiere außerordentlich zu kündigen. Im Falle einer solchen außerordentlichen Kündigung zahlt die Emittentin den Kündigungsbetrag innerhalb von vier

Bankgeschäftstagen nach der Bekanntmachung der Kündigung. In diesem Fall kann der Kündigungsbetrag unter Umständen auch erheblich unter dem für das Wertpapier gezahlten Kaufpreis liegen und bis auf Null (0) sinken (**Totalverlust des eingesetzten Kapitals**).

Emissionstermin (Valutatag)			28. September 2021			
WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GJ8, DE000PH5GJ89 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	22.500,0000	40.000,0000	40.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GJ9, DE000PH5GJ97 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	22.500,0000	48.000,0000	48.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKA, DE000PH5GKA8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	23.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKB, DE000PH5GKB6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	23.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKC, DE000PH5GKC4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	23.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKD, DE000PH5GKD2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	23.500,0000	29.800,0000	29.800,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKE, DE000PH5GKE0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	23.500,0000	33.000,0000	33.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKF, DE000PH5GKF7 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	23.500,0000	40.000,0000	40.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKG, DE000PH5GKG5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	23.500,0000	48.000,0000	48.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKH, DE000PH5GKH3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.000,0000	28.200,0000	28.200,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKJ, DE000PH5GKJ9 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKK, DE000PH5GKK7 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKL, DE000PH5GKL5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKM, DE000PH5GKM3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.000,0000	52.000,0000	52.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKN, DE000PH5GKN1 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.500,0000	29.800,0000	29.800,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKP, DE000PH5GKP6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.500,0000	33.000,0000	33.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKQ, DE000PH5GKQ4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.500,0000	40.000,0000	40.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKR, DE000PH5GKR2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.500,0000	48.000,0000	48.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKS, DE000PH5GKS0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.000,0000	28.200,0000	28.200,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKT, DE000PH5GKT8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	16.12.2022/ 22.12.2022

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GKU, DE000PH5GKU6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKV, DE000PH5GKV4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKW, DE000PH5GKW2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.000,0000	52.000,0000	52.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKX, DE000PH5GKX0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.500,0000	29.800,0000	29.800,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKY, DE000PH5GKY8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.500,0000	33.000,0000	33.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GKZ, DE000PH5GKZ5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.500,0000	40.000,0000	40.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK0, DE000PH5GK03 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.500,0000	48.000,0000	48.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK1, DE000PH5GK11 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	26.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK2, DE000PH5GK29 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	26.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK3, DE000PH5GK37 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	26.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK4, DE000PH5GK45 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	27.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK5, DE000PH5GK52 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	27.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK6, DE000PH5GK60 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	27.000,0000	48.000,0000	48.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK7, DE000PH5GK78 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	28.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK8, DE000PH5GK86 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	28.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GK9, DE000PH5GK94 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	28.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GLA, DE000PH5GLA6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	29.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GLB, DE000PH5GLB4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	29.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GLC, DE000PH5GLC2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	30.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GLD, DE000PH5GLD0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	31.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022
PH5GLE, DE000PH5GLE8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	32.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	16.12.2022/ 22.12.2022

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GLF, DE000PH5GLF5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	19.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLG, DE000PH5GLG3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	19.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLH, DE000PH5GLH1 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	20.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLJ, DE000PH5GLJ7 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	20.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLK, DE000PH5GLK5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	20.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLL, DE000PH5GLL3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	21.000,0000	29.800,0000	29.800,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLM, DE000PH5GLM1 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	21.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLN, DE000PH5GLN9 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	21.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLP, DE000PH5GLP4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	22.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLQ, DE000PH5GLQ2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	22.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLR, DE000PH5GLR0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	22.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLS, DE000PH5GLS8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	23.000,0000	29.800,0000	29.800,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLT, DE000PH5GLT6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	23.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLU, DE000PH5GLU4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	23.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLV, DE000PH5GLV2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	23.000,0000	48.000,0000	48.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLW, DE000PH5GLW0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.000,0000	28.200,0000	28.200,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLX, DE000PH5GLX8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLY, DE000PH5GLY6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GLZ, DE000PH5GLZ3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL0, DE000PH5GL02 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	24.000,0000	52.000,0000	52.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL1, DE000PH5GL10 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.000,0000	29.800,0000	29.800,0000	20.01.2023/ 26.01.2023

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen*	Basiswert* (Index mit ISIN)	Bezugs-verhältnis*	Barriere* in Indexpunkten	BonusLevel* in Indexpunkten	Cap* in Indexpunkten	Bewertungstag*/ Fälligkeitstag*
PH5GL2, DE000PH5GL28 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL3, DE000PH5GL36 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL4, DE000PH5GL44 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	25.000,0000	48.000,0000	48.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL5, DE000PH5GL51 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	26.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL6, DE000PH5GL69 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	26.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL7, DE000PH5GL77 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	26.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL8, DE000PH5GL85 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	27.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GL9, DE000PH5GL93 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	27.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GMA, DE000PH5GMA4 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	27.000,0000	48.000,0000	48.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GMB, DE000PH5GMB2 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	28.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GMC, DE000PH5GMC0 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	28.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GMD, DE000PH5GMD8 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	28.000,0000	44.000,0000	44.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GME, DE000PH5GME6 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	30.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GMF, DE000PH5GMF3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	32.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	20.01.2023/ 26.01.2023
PH5GMG, DE000PH5GMG1 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	18.000,0000	36.000,0000	36.000,0000	16.06.2023/ 22.06.2023
PH5GMH, DE000PH5GMH9 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	19.000,0000	33.000,0000	33.000,0000	16.06.2023/ 22.06.2023
PH5GMJ, DE000PH5GMJ5 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	19.000,0000	40.000,0000	40.000,0000	16.06.2023/ 22.06.2023
PH5GMK, DE000PH5GMK3 / 50.000	The Dow Jones Industrial Average® Index (Kurs Index), US2605661048	0,01	20.000,0000	31.400,0000	31.400,0000	16.06.2023/ 22.06.2023

#### Rangordnung:

Die Wertpapiere begründen unmittelbare und nicht nachrangige Verbindlichkeiten der Emittentin, für die die Emittentin keine Sicherheiten bestellt hat. Die Wertpapiere stehen untereinander und mit allen sonstigen gegenwärtigen und künftigen unbesicherten und nicht nachrangigen Verbindlichkeiten der Emittentin im gleichen Rang, ausgenommen solche Verbindlichkeiten, denen aufgrund zwingender gesetzlicher Vorschriften Vorrang zukommt.

#### Wo werden die Wertpapiere gehandelt?

Entfällt. Die Wertpapiere werden nicht an einem geregelten Markt notiert. Die Beantragung der Einbeziehung der Wertpapiere in den Freiverkehr der Frankfurter Börse und der Börse Stuttgart ist beabsichtigt.

Die Einbeziehung der Wertpapiere in den Handel ist (frühestens) für den 24. September 2021 geplant.

## Wird für die Wertpapiere eine Garantie gestellt?

BNP Paribas S.A., Paris, Frankreich, (die "Garantin") hat eine unbedingte und unwiderrufliche Garantie (die "Garantie") für die ordnungsgemäße Zahlung von sämtlichen nach Maßgabe der Wertpapierbedingungen zahlbaren Beträgen übernommen, soweit und sobald die entsprechende Zahlung nach den Wertpapierbedingungen fällig wäre.

## Wer ist die Garantin der Wertpapiere?

<b>Sitz und Rechtsform:</b>	Die Garantin wurde in Frankreich als Aktiengesellschaft nach französischem Recht (société anonyme) (mit der Rechtsträgerkennung (LEI): R0MUWSFPU8MPRO8K5P83) gegründet. Ihre Hauptverwaltung hat die Anschrift 16, boulevard des Italiens - 75009 Paris, Frankreich.
<b>Haupttätigkeiten:</b>	BNP Paribas S.A. ist, nach Selbsteinschätzung, eine der führenden Banken Frankreichs und unterhält Zweigstellen und Tochtergesellschaften in allen wichtigen Märkten.
<b>Hauptanteilseigner:</b>	Zum 30. Juni 2021 sind die Hauptaktionäre die Société Fédérale de Participations et d'Investissement ("SFPI"), eine public-interest société anonyme (Aktiengesellschaft), die im Auftrag der belgischen Regierung handelt, die 7,7% des Grundkapitals hält, BlackRock Inc. mit einer Beteiligung von 6,0 % des Grundkapitals sowie das Großherzogtum Luxemburg mit einer Beteiligung von 1,0 % des Grundkapitals. Nach bestem Wissen von BNPP besitzt kein Aktionär außer SFPI und BlackRock Inc. mehr als 5 % ihres Kapitals oder ihrer Stimmrechte.
<b>Identität der Hauptgeschäftsführer:</b>	Jean-Laurent Bonnafé, Chief Executive Officer der BNP Paribas S.A.
<b>Identität der Abschlussprüfer:</b>	Deloitte & Associés, 6, place de la Pyramide, Paris-La Défense Cedex (92), Frankreich PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, Neuilly-sur-Seine (92), Frankreich Mazars, 28, rue Fernand Forest, Suresnes (92), Frankreich

## Welches sind die wesentlichen Finanzinformationen über die Garantin?

**Tabelle 1: Gewinn- und Verlustrechnung**

	<b>31.12.2020 (geprüft) in Mio. EUR</b>	<b>31.12.2019 (geprüft) in Mio. EUR</b>	<b>IH21 (ungeprüft) in Mio. EUR</b>	<b>IH20 (ungeprüft) in Mio. EUR</b>
Umsatzerlöse	44.275	44.597	23.605	22.563
Risikokosten	(5.717)	(3.203)	(1.709)	(2.873)
Konzernanteil am Jahresüberschuss	7.067	8.173	4.679	3.581

**Tabelle 2: Bilanz**

	<b>30.06.2021 (ungeprüft) in Mio. EUR</b>	<b>31.12.2020 (geprüft) in Mio. EUR</b>	<b>31.12.2019 (geprüft) in Mio. EUR</b>
Bilanzsumme Konzern	2.671.803	2.488.491	2.164.713
Konsolidierte Kredite und Forderungen an Kunden	825.226	809.533	805.777
Konsolidierte Verbindlichkeiten an Kunden	1.000.870	940.991	834.667
Eigenkapital (Konzernanteil)	115.991	112.799	107.453

Die geprüften konsolidierten Jahresabschlüsse der Garantin zum 31. Dezember 2019 und zum 31. Dezember 2020 sowie der Finanzbericht für den Sechsmonatszeitraum zum 30. Juni 2021 wurden nach Internationalen Rechnungslegungsstandards (International Financial Reporting Standards - IFRS) aufgestellt.

## Welches sind die zentralen Risiken, die für die Garantin spezifisch sind?

**Insolvenzrisiko/Liquiditätsrisiko in Bezug auf die Garantin:** Jeder Anleger trägt mittelbar, aufgrund der etwaigen Garantie der BNP Paribas S.A. und des zwischen der Emittentin und der Garantin bestehenden Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrags auch das Insolvenz- und Liquiditätsrisiko im Hinblick auf die Garantin. Die Geschäftstätigkeit der Garantin als internationalem Finanzkonzern ist durch sieben Hauptrisiken geprägt (Kreditrisiko, Gegenparteirisiko und Verbriefungsrisiko im Bankenportfolio; Operationales Risiko; Marktrisiko; Liquiditäts- und Refinanzierungsrisiko; Risiken im Zusammenhang mit dem gesamtwirtschaftlichen Umfeld und Marktumfeld; Aufsichtsrechtliches Risiko; Risiken im Zusammenhang mit dem Wachstum der BNPP in ihrem derzeitigen Umfeld). Eine Insolvenz der Garantin kann sogar zum vollständigen Verlust des Kapitalbetrags führen, den Wertpapierinhaber beim Kauf der Wertpapiere bezahlt haben (**Totalverlustrisiko**).

**Abwicklungsmaßnahmen in Bezug auf die Garantin:** Zudem können Maßnahmen, die in Bezug auf BNP Paribas S.A. (in ihrer Funktion als unter dem bestehenden Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrag ausgleichsverpflichtete Vertragspartei) bzw. die BNP Paribas Gruppe in Frankreich gemäß der Umsetzung der Sanierungs- und Abwicklungsrichtlinie in französisches Recht getroffen werden, mittelbar negative Auswirkungen auf die Emittentin haben. Anleger sind damit auch dem Risiko ausgesetzt, dass BNP Paribas S.A. ihre Verpflichtungen aus dem Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrag – beispielsweise im Falle einer Insolvenz (Zahlungsunfähigkeit / Überschuldung) oder einer behördlichen Anordnung von Abwicklungsmaßnahmen nach französischem Recht – nicht erfüllen kann. Abwicklungsmaßnahmen gegen die Garantin können daher sogar zum vollständigen Verlust des Kapitalbetrags führen, den Wertpapierinhaber beim Kauf der Wertpapiere bezahlt haben (**Totalverlustrisiko**).

## Welches sind die zentralen Risiken, die für die Wertpapiere spezifisch sind?

**Keine Einlagensicherung.** Die Wertpapiere unterliegen keiner Einlagensicherung. **Ein Totalverlust des Aufgewendeten Kapitals ist möglich.**

**Abhangigkeit von der Kursentwicklung des Basiswerts:**

Die Auswahl des Basiswerts durch die Emittentin beruht nicht zwangslaufig auf ihren Einschatzungen bezuglich der zukunftigen Wertentwicklung des ausgewahlten Basiswerts. Zu beachten ist, dass eine Veranderung des Kurses des dem Wertpapier zugrundeliegenden Basiswerts dazu fuhren kann, dass der Auszahlungsbetrag entsprechend der Wertentwicklung des Basiswerts auch erheblich unter dem fur das Wertpapier gezahlten Kaufpreis liegen und dadurch fur den Wertpapierinhaber ein erheblicher Verlust in Bezug auf den fur das Wertpapier gezahlten Kaufpreis entstehen kann.

**Risiken im Zusammenhang mit dem Auszahlungs- bzw. Tilgungsprofil:**

**Abhangigkeit vom Basiswert**

Wenn der fur die Barrierenbetrachtung magebliche Kurs, die Barriere erreicht oder unterschritten hat, kann der Auszahlungsbetrag abhangig von der Entwicklung des jeweils zugrundeliegenden Basiswerts, substantiell unter den fur ein Wertpapier gezahlten Kaufpreis sinken. Das Wertpapier wirft dann keinen Ertrag ab, sondern beinhaltet das Risiko des Totalverlustes des eingesetzten Betrags bzw. eines Verlusts, der nahezu dem gesamten fur ein Wertpapier gezahlten Kaufpreis entspricht.

**Marktstorungen:** Fur Wertpapierinhaber besteht das Risiko, dass der Eintritt einer in den Wertpapierbedingungen beschriebenen Marktstorung den Wert der Wertpapiere nachteilig beeinflusst. Außerdem kann eine Marktstorung die Zahlung des jeweils geschuldeten Betrags verzögern.

**Anpassungen, Kundigungs- und Wiederanlagerisiko:** Wertpapierinhaber tragen das Risiko, dass die Wertpapiere gema den Wertpapierbedingungen von der Emittentin angepasst oder gekundigt werden. Im Fall einer Kundigung kann der Kundigungsbetrag auch erheblich unter dem fur den Erwerb der Wertpapiere aufgewendeten Kapitalbetrag liegen. Auch ein **Totalverlust** ist moglich. Zudem sind Wertpapierinhaber dem Risiko ausgesetzt, dass sie erhaltene Betrage nur zu weniger gunstigen Konditionen wieder anlegen konnen, sog. Wiederanlagerisiko.

**Marktpreisrisiken:** Wertpapierinhaber tragen die Risiken im Zusammenhang mit der Preisbildung der Wertpapiere. So steht die Wertentwicklung des Basiswerts und damit die Wertentwicklung der Wertpapiere wahrend der Laufzeit zum Zeitpunkt ihres Kaufs nicht fest.

**Liquiditatsrisiko:** Wertpapierinhaber tragen das Risiko, dass es gegebenenfalls keinen liquiden Sekundarmarkt fur den Handel mit den Wertpapieren gibt und dass sie die Wertpapiere nicht zu einer bestimmten Zeit oder zu einem bestimmten Kurs verkaufen konnen.

**Risiken im Zusammenhang mit dem Basiswert:** Das Regelwerk des Index unterliegt moglichen Anderungen durch den Betreiber des Index. Die Emittentin hat keinen Einfluss auf solche etwaigen Anderungen, die unter Umstanden die Zahlung an die Inhaber von Wertpapieren (negativ) beeinflussen knnen. Sofern es sich bei dem Basiswert um einen Preisindex (auch Kursindex genannt) handelt, ist zu beachten, dass – anders als bei Performanceindizes – Dividendausschttungen der im Basiswert enthaltenen Aktien nicht zu einer Erhohung des Stands des Basiswerts fuhren. Anleger profitieren somit nicht von Dividenden oder sonstigen Ausschttungen in Bezug auf die in einem Preisindex enthaltenen Aktien.

**Risiken aus moglichen Interessenkonflikten:** Die Emittentin, die Garantin und ihre verbundenen Unternehmen konnen Interessen verfolgen, die den Interessen der Wertpapierinhaber widersprechen oder diese nicht bercksichtigen. Dies kann im Zusammenhang mit der Ausubung anderer Funktionen oder bei der Durchfuhrung weiterer Transaktionen erfolgen. Mogliche Interessenkonflikte konnen sich nachteilig auf den Wert der Wertpapiere auswirken.

**Abschnitt D – Basisinformationen uber das offentliche Angebot von Wertpapieren und/oder die Zulassung zum Handel an einem geregelten Markt**

**Zu welchen Konditionen und nach welchem Zeitplan konnen Anleger in dieses Wertpapier investieren?**

**Allgemeine Bedingungen, Konditionen und voraussichtlicher Zeitplan des Angebots**

Die Wertpapiere werden von BNP Paribas Arbitrage S.N.C., Paris, Frankreich ab dem 24. September 2021 interessierten Anlegern angeboten. Das offentliche Angebot endet mit Ablauf der Gultigkeit des Prospekts bzw. des jeweils aktuellen Basisprospekts.

**Einzelheiten der Zulassung zum Handel an einem geregelten Markt**

Die Wertpapiere werden nicht an einem geregelten Markt notiert. Die Beantragung der Einbeziehung der Wertpapiere in den Freiverkehr der Frankfurter Borse und der Borse Stuttgart ist beabsichtigt.

Die Einbeziehung der Wertpapiere in den Handel ist (fruhestens) fur den 24. September 2021 geplant.

**Schatzung der Gesamtkosten**

Der Anleger kann die Wertpapiere zum Ausgabepreis bzw. zum Verkaufspreis erwerben. Dem Anleger werden uber den Ausgabepreis bzw. den Verkaufspreis hinaus keine weiteren Kosten durch die Emittentin oder Anbieterin in Rechnung gestellt; vorbehalten bleiben jedoch Kosten, die dem Erwerber im Rahmen des Erwerbs der Wertpapiere uber Banken und Sparkassen, sonstige Vertriebswege oder die jeweilige Wertpapierborse entstehen knnen und uber die weder die Emittentin noch die Anbieterin eine Aussage treffen knnen.

Der Anfangliche Ausgabepreis enthalt jeweils die produktsspezifischen Einstiegskosten (zum Datum der Endgultigen Angebotsbedingungen).

**Wer ist der Anbieter und/oder die die Zulassung zum Handel beantragende Person?**

Anbieterin: BNP Paribas Arbitrage S.N.C. (mit eingetragenem Sitz in 1 Rue Laffitte, Paris, 75009, Frankreich, LEI: 6EWKU0FGVX5QQJHFGT48) wurde in Frankreich als Personengesellschaft nach franzosischem Recht (Socit en Nom Collectif) gegrundet.

**Weshalb wird dieser Prospekt erstellt?**

Im Rahmen des Angebots steht die Gewinnerzielung im Vordergrund. Die Emittentin wird den Nettoerlos der Emission ausschlielich zur Absicherung ihrer Verbindlichkeiten gegenuber den Wertpapierinhabern unter den Wertpapieren verwenden.