

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

LEI 549300TS3U4JKMR1B479

Endgültige Angebotsbedingungen Nr. 37156-001

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^{PRO} 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 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 bzw. die Endgültigen Bedingungen auf der Internetseite 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^{PRO} 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 |
|--|----------------------|
| S&P 500® Index (Kurs Index), ISIN US78378X1072 | eu.spindices.com |

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:

S&P 500® Index (Kurs Index)

Der S&P 500® Index (Kurs Index) ("S&P 500®") ist ein Index bestehend aus Aktien von 500 Unternehmen aus den Vereinigten Staaten von Amerika. Die Auswahl erfolgt auf Basis der Marktkapitalisierung, der Liquidität, des Sitzes, eines Mindeststreubesitzes, der Sektorklassifikation, der nachhaltigen Rentabilität und einer Mindestlistingdauer an einer relevanten Börse.

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

Der S&P 500® wird in Echtzeit (real-time) in USD berechnet und veröffentlicht.

Die Berechnung des Index erfolgt gewichtet nach Marktkapitalisierung der im Streubesitz (Free Float) befindlichen Aktien.

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:

S&P 500® Index (Kurs Index)

Die Bezeichnung "**S&P 500®**" ("Standard & Poor's 500®") ist eingetragenes Warenzeichen von S&P Dow Jones Indices LLC..

S&P Dow Jones Indices LLC ist Lizenzgeber unter den Wertpapieren. Die Nutzung der vorgenannten Markenzeichen ist der Emittentin aufgrund von Lizenzverträgen zwischen dem Lizenzgeber und der Emittentin bzw. der BNP PARIBAS ("Lizenznehmer") gestattet.

Die Wertpapiere werden vom Lizenzgeber nicht gesponsert, unterstützt, verkauft oder vertrieben. Der Lizenzgeber macht keinerlei Zusagen oder übernimmt irgendeine Gewährleistung, weder ausdrücklich noch implizit, gegenüber den Inhabern der Wertpapiere oder anderen Personen darüber, ob eine Anlage in Wertpapieren allgemein oder in den Wertpapieren im Besonderen anzuraten ist. Die Beziehung zwischen dem Lizenzgeber und dem Lizenznehmer ist eingeschränkt auf die eines Lizenzgebers für Standard & Poor's 500® und bestimmter Handelsmarken, Handelsnamen und Dienstleistungsmarken der Lizenzgeber. Der Index wird von dem Lizenzgeber festgesetzt, zusammengestellt und kalkuliert, ohne Berücksichtigung des Lizenznehmers oder der Wertpapiere. Der Lizenzgeber ist weder verantwortlich für oder beteiligt an der Festsetzung des Zeitpunktes, des Preises oder der Anzahl der zu begebenden Wertpapiere noch an der Festsetzung oder Berechnung der Formel, nach der der Abrechnungsbetrag für die Wertpapiere ermittelt wird. Der Lizenzgeber trifft keinerlei Verpflichtungen oder Haftungen im Zusammenhang mit der Administration, dem Marketing oder dem Handel mit den Wertpapieren.

Der S&P 500® 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 Unterlizenzierung 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 S&P 500®.

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 JEDLICHER HAFTUNG HINSICHTLICH DER MARKTGÄNGIGKEIT ODER GEEIGNETHEIT FÜR EINEN BESTIMMTEN ZWECK ODER EINE BESTIMMTE VERWENDUNG ODER ERGEBNISSE, DIE VON BNP PARIBAS S.A. ODER EINER IHRER TOCHTERGESELLSCHAFTEN, DEN INHABERN DER WERTPAPIERE, ODER IRGEND EINER 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 VERTRAGLICHER, DELIKTISCHER ODER VERSCHULDENSUNABHÄNGIGER ODER ANDERER HAFTUNG. AUSSER DEM LIZENZGEBER GIBT ES KEINEN DRITTEN BEGÜNSTIGTEN AUS IRGENDWELCHEN VERTRÄGEN ODER VEREINBARUNGEN ZWISCHEN S&P DOW JONES INDICES UND BNP PARIBAS S.A. ODER EINER IHRER TOCHTERGESLLSCHAFTEN.

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^{PRO} 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:

$$\text{MIN}(\text{MAX}(\text{BonusLevel}; \text{Referenzpreis}); \text{Cap}) \times \text{B}$$

- (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:

$$\text{MIN}(\text{Referenzpreis}; \text{Cap}) \times \text{B}$$

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.

"Barrieren-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 S&P 500® Index (Kurs Index) der am Bewertungstag von der Terminbörse festgestellte und veröffentlichte Settlement Price (S&P 500 (SET)) 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 Indexpörse für den regulären Handel geöffnet sind, und
- (b) der Kurs des Basiswerts durch die Referenzstelle festgestellt wird.

"Indexbestandteile": sind die dem Basiswert zugrundeliegenden Werte.

"Indexpörse": 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 wegfallenden Nachkommastelle eine 1, 2, 3 oder 4 ist, dann wird abgerundet. Ist die Ziffer an der ersten wegfallenden Nachkommastelle eine 5, 6, 7, 8 oder 9, dann wird aufgerundet.

"Referenzpreis": ist der am Bewertungstag von der Terminbörse festgestellte und veröffentlichte Final Cash Settlement Price bezogen auf den Basiswert S&P 500® 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^{PRO} Zertifikate)

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Typ* | Referenzwährung* | Referenzstelle* | Terminbörse** | Bezugsverhältnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Beobachtungszeitraum* Beginn/ Ende | Bewertungstag*/ Fälligkeitstag* |
|---|--|---------|------------------|---------------------------|---------------------------------------|-------------------|---------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------|---------------------------------|
| PH5GNK, DE000PH5GNK1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.400,0000 | 6.600,0000 | 6.600,0000 | 24.09.2021 / 18.03.2022 | 18.03.2022/ 24.03.2022 |
| PH5GNL, DE000PH5GNL9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.600,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 24.09.2021 / 18.03.2022 | 18.03.2022/ 24.03.2022 |
| PH5GNM, DE000PH5GNM7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 18.03.2022 | 18.03.2022/ 24.03.2022 |
| PH5GNN, DE000PH5GNN5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 4.200,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 24.09.2021 / 18.03.2022 | 18.03.2022/ 24.03.2022 |
| PH5GNP, DE000PH5GNP0 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 24.09.2021 / 20.05.2022 | 20.05.2022/ 26.05.2022 |
| PH5GNQ, DE000PH5GNQ8 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 24.09.2021 / 20.05.2022 | 20.05.2022/ 26.05.2022 |
| PH5GNR, DE000PH5GNR6 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 20.05.2022 | 20.05.2022/ 26.05.2022 |
| PH5GNS, DE000PH5GNS4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 6.800,0000 | 6.800,0000 | 24.09.2021 / 17.06.2022 | 17.06.2022/ 23.06.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Typ* | Referenzwahrung* | Referenzstelle* | Terminborse** | Bezugsverhaltnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Beobachtungszeitraum* Beginn/ Ende | Bewertungstag*/ Falligkeitstag* |
|---|--|---------|-------------------|------------------------------------|--|--------------------|---------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------|----------------------------------|
| PH5GNT, DE000PH5GNT2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 17.06.2022 | 17.06.2022/ 23.06.2022 |
| PH5GNU, DE000PH5GNU0 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 24.09.2021 / 15.07.2022 | 15.07.2022/ 21.07.2022 |
| PH5GNV, DE000PH5GNV8 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 15.07.2022 | 15.07.2022/ 21.07.2022 |
| PH5GNW, DE000PH5GNW6 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GNX, DE000PH5GNX4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GNY, DE000PH5GNY2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GNZ, DE000PH5GNZ9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN0, DE000PH5GN00 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Typ* | Referenzwahrung* | Referenzstelle* | Terminborse** | Bezugsverhaltnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Beobachtungszeitraum* Beginn/ Ende | Bewertungstag*/ Falligkeitstag* |
|---|--|---------|-------------------|------------------------------------|--|--------------------|---------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------|----------------------------------|
| PH5GN1, DE000PH5GN18 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN2, DE000PH5GN26 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN3, DE000PH5GN34 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN4, DE000PH5GN42 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN5, DE000PH5GN59 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 6.600,0000 | 6.600,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN6, DE000PH5GN67 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN7, DE000PH5GN75 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN8, DE000PH5GN83 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Typ* | Referenzwahrung* | Referenzstelle* | Terminborse** | Bezugsverhaltnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Beobachtungszeitraum* Beginn/ Ende | Bewertungstag*/ Falligkeitstag* |
|---|--|---------|-------------------|------------------------------------|--|--------------------|---------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------|----------------------------------|
| PH5GN9, DE000PH5GN91 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GPA, DE000PH5GPA7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GPB, DE000PH5GPB5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.800,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GPC, DE000PH5GPC3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 19.08.2022 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GPD, DE000PH5GPD1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.300,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 24.09.2021 / 16.09.2022 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPE, DE000PH5GPE9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.300,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 24.09.2021 / 16.09.2022 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPF, DE000PH5GPF6 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.400,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 24.09.2021 / 16.09.2022 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPG, DE000PH5GPG4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.400,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 24.09.2021 / 16.09.2022 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Typ* | Referenzwahrung* | Referenzstelle* | Terminborse** | Bezugsverhaltnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Beobachtungszeitraum* Beginn/ Ende | Bewertungstag*/ Falligkeitstag* |
|---|--|---------|-------------------|------------------------------------|--|--------------------|---------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------|----------------------------------|
| PH5GPH, DE000PH5GPH2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.500,0000 | 3.500,0000 | 3.500,0000 | 24.09.2021 / 16.09.2022 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPJ, DE000PH5GPJ8 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.500,0000 | 3.700,0000 | 3.700,0000 | 24.09.2021 / 16.09.2022 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPK, DE000PH5GPK6 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.700,0000 | 3.500,0000 | 3.500,0000 | 24.09.2021 / 16.09.2022 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPL, DE000PH5GPL4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 24.09.2021 / 16.09.2022 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPM, DE000PH5GPM2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.900,0000 | 3.300,0000 | 3.300,0000 | 24.09.2021 / 16.09.2022 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPN, DE000PH5GPN0 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 6.800,0000 | 6.800,0000 | 24.09.2021 / 16.09.2022 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPP, DE000PH5GPP5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.600,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 24.09.2021 / 16.09.2022 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPQ, DE000PH5GPQ3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.400,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Typ* | Referenzwährung* | Referenzstelle* | Terminbörse** | Bezugsverhältnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Beobachtungszeitraum* Beginn/ Ende | Bewertungstag*/ Fälligkeitstag* |
|---|--|---------|------------------|------------------------------------|--|-------------------|---------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------|---------------------------------|
| PH5GPR, DE000PH5GPR1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.400,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPS, DE000PH5GPS9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.400,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPT, DE000PH5GPT7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.400,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPU, DE000PH5GPU5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.600,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPV, DE000PH5GPV3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.600,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPW, DE000PH5GPW1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.600,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPX, DE000PH5GPX9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.600,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPY, DE000PH5GPY7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Typ* | Referenzwährung* | Referenzstelle* | Terminbörse** | Bezugsverhältnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Beobachtungszeitraum* Beginn/ Ende | Bewertungstag*/ Fälligkeitstag* |
|---|--|---------|------------------|------------------------------------|--|-------------------|---------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------|---------------------------------|
| PH5GPZ, DE000PH5GPZ4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP0, DE000PH5GP08 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP1, DE000PH5GP16 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP2, DE000PH5GP24 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP3, DE000PH5GP32 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP4, DE000PH5GP40 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP5, DE000PH5GP57 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP6, DE000PH5GP65 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Typ* | Referenzwahrung* | Referenzstelle* | Terminborse** | Bezugsverhaltnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Beobachtungszeitraum* Beginn/ Ende | Bewertungstag*/ Falligkeitstag* |
|---|--|---------|-------------------|------------------------------------|--|--------------------|---------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------|----------------------------------|
| PH5GP7, DE000PH5GP73 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 6.600,0000 | 6.600,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP8, DE000PH5GP81 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP9, DE000PH5GP99 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GQA, DE000PH5GQA5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GQB, DE000PH5GQB3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GQC, DE000PH5GQC1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.200,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GQD, DE000PH5GQD9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.800,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GQE, DE000PH5GQE7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 21.10.2022 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Typ* | Referenzwahrung* | Referenzstelle* | Terminborse** | Bezugsverhaltnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Beobachtungszeitraum* Beginn/ Ende | Bewertungstag*/ Falligkeitstag* |
|---|--|---------|-------------------|------------------------------------|--|--------------------|---------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------|----------------------------------|
| PH5GQF, DE000PH5GQF4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.400,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQG, DE000PH5GQG2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.400,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQH, DE000PH5GQH0 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.400,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQJ, DE000PH5GQJ6 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.400,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQK, DE000PH5GQK4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.600,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQL, DE000PH5GQL2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.600,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQM, DE000PH5GQM0 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.600,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQN, DE000PH5GQN8 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.600,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Typ* | Referenzwährung* | Referenzstelle* | Terminbörse** | Bezugsverhältnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Beobachtungszeitraum* Beginn/ Ende | Bewertungstag*/ Fälligkeitstag* |
|---|--|---------|------------------|------------------------------------|--|-------------------|---------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------|---------------------------------|
| PH5GQP, DE000PH5GQP3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQQ, DE000PH5GQQ1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQR, DE000PH5GQR9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQS, DE000PH5GQS7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQT, DE000PH5GQT5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 2.800,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQU, DE000PH5GQU3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQV, DE000PH5GQV1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQW, DE000PH5GQW9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | Classic | USD | S&P Dow Jones Indices LLC | CBOE (Chicago Board Options Exchange) | 0,01 | 3.000,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 24.09.2021 / 18.11.2022 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |

* 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 "**Nichtgenehmigungsereignisses**": 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 Nichtgenehmigungsereignis 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 "**Ablehnungsereignisses**": 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 Widerrufereignisses**": 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 Widerrufereignis 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 Anpassungsereignis**") finden die Regelungen der Absätze (1) bis (5) hinsichtlich einer Anpassung bzw. eines Anpassungsereignisses 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 Indexbörse, 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 Terminbörse;
 - (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 Terminbörse zu tätigen;
 - (c) dass die Indexbörse in Bezug auf Indexbestandteile, die mindestens 20 % der Börsenkapitalisierung aller Indexbestandteile darstellen, oder die Terminbörse vor ihrem regulären Handelsschluss schließt. Das gilt nicht, wenn die Indexbörse oder Terminbörse den Handelsschluss mindestens eine Stunde vor dem tatsächlichen Handelsschluss oder, wenn dieser Zeitpunkt früher liegt, dem letzten Zeitpunkt für die Ordereingabe bei der Indexbörse oder Terminbörse 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 Indexbörse 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 produktspezifischen 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 produktspezifische Einstiegskosten (zum Datum dieser Endgültigen Angebotsbedingungen) | Volumen |
|--------------|---|--|----------------|
| DE000PH5GNK1 | 51,68 | 0,449 | 400.000 |
| DE000PH5GNL9 | 46,45 | 0,42 | 400.000 |
| DE000PH5GNM7 | 39,71 | 0,303 | 400.000 |
| DE000PH5GNN5 | 38,09 | 0,238 | 400.000 |
| DE000PH5GNP0 | 29,78 | 0,193 | 400.000 |
| DE000PH5GNQ8 | 28,17 | 0,183 | 400.000 |
| DE000PH5GNR6 | 39,02 | 0,27 | 400.000 |
| DE000PH5GNS4 | 52,29 | 0,48 | 400.000 |

| ISIN | Anfänglicher Ausgabepreis in EUR | Im Anfänglichen Ausgabepreis enthaltene produktspezifische Einstiegskosten (zum Datum dieser Endgültigen Angebotsbedingungen) | Volumen |
|--------------|---|--|----------------|
| DE000PH5GNT2 | 38,78 | 0,276 | 400.000 |
| DE000PH5GNU0 | 28,01 | 0,194 | 400.000 |
| DE000PH5GNV8 | 38,56 | 0,278 | 400.000 |
| DE000PH5GNW6 | 29,45 | 0,221 | 400.000 |
| DE000PH5GNX4 | 32,47 | 0,244 | 400.000 |
| DE000PH5GNY2 | 35,46 | 0,275 | 400.000 |
| DE000PH5GNZ9 | 41,40 | 0,331 | 400.000 |
| DE000PH5GN00 | 47,33 | 0,405 | 400.000 |
| DE000PH5GN18 | 27,90 | 0,203 | 400.000 |
| DE000PH5GN26 | 30,87 | 0,239 | 400.000 |
| DE000PH5GN34 | 33,78 | 0,26 | 400.000 |
| DE000PH5GN42 | 39,52 | 0,326 | 400.000 |
| DE000PH5GN59 | 50,89 | 0,474 | 400.000 |
| DE000PH5GN67 | 29,35 | 0,217 | 400.000 |
| DE000PH5GN75 | 32,22 | 0,244 | 400.000 |
| DE000PH5GN83 | 35,01 | 0,277 | 400.000 |
| DE000PH5GN91 | 40,45 | 0,347 | 400.000 |
| DE000PH5GPA7 | 45,84 | 0,427 | 400.000 |
| DE000PH5GPB5 | 37,86 | 0,296 | 400.000 |
| DE000PH5GPC3 | 38,29 | 0,281 | 400.000 |
| DE000PH5GPD1 | 32,77 | 0,245 | 400.000 |
| DE000PH5GPE9 | 35,93 | 0,271 | 400.000 |
| DE000PH5GPF6 | 31,12 | 0,235 | 400.000 |
| DE000PH5GPG4 | 34,25 | 0,268 | 400.000 |
| DE000PH5GPH2 | 28,72 | 0,222 | 400.000 |
| DE000PH5GPJ8 | 30,27 | 0,235 | 400.000 |
| DE000PH5GPK6 | 28,64 | 0,22 | 400.000 |
| DE000PH5GPL4 | 27,85 | 0,216 | 400.000 |
| DE000PH5GPM2 | 27,08 | 0,209 | 400.000 |
| DE000PH5GPN0 | 50,82 | 0,532 | 400.000 |
| DE000PH5GPP5 | 43,64 | 0,43 | 400.000 |
| DE000PH5GPQ3 | 29,45 | 0,277 | 400.000 |
| DE000PH5GPR1 | 32,55 | 0,325 | 400.000 |
| DE000PH5GPS9 | 35,64 | 0,361 | 400.000 |
| DE000PH5GPT7 | 41,82 | 0,432 | 400.000 |
| DE000PH5GPU5 | 27,81 | 0,265 | 400.000 |
| DE000PH5GPV3 | 30,85 | 0,305 | 400.000 |
| DE000PH5GPW1 | 33,87 | 0,351 | 400.000 |
| DE000PH5GPX9 | 39,88 | 0,432 | 400.000 |
| DE000PH5GPY7 | 29,24 | 0,281 | 400.000 |
| DE000PH5GPZ4 | 32,20 | 0,325 | 400.000 |
| DE000PH5GP08 | 35,12 | 0,377 | 400.000 |
| DE000PH5GP16 | 40,92 | 0,466 | 400.000 |
| DE000PH5GP24 | 46,69 | 0,584 | 400.000 |

| ISIN | Anfänglicher Ausgabepreis in EUR | Im Anfänglichen Ausgabepreis enthaltene produktspezifische Einstiegskosten (zum Datum dieser Endgültigen Angebotsbedingungen) | Volumen |
|--------------|----------------------------------|---|---------|
| DE000PH5GP32 | 27,72 | 0,264 | 400.000 |
| DE000PH5GP40 | 30,62 | 0,304 | 400.000 |
| DE000PH5GP57 | 33,47 | 0,349 | 400.000 |
| DE000PH5GP65 | 39,06 | 0,45 | 400.000 |
| DE000PH5GP73 | 50,09 | 0,688 | 400.000 |
| DE000PH5GP81 | 29,14 | 0,281 | 400.000 |
| DE000PH5GP99 | 31,94 | 0,322 | 400.000 |
| DE000PH5GQA5 | 34,66 | 0,371 | 400.000 |
| DE000PH5GQB3 | 39,95 | 0,472 | 400.000 |
| DE000PH5GQC1 | 45,15 | 0,61 | 400.000 |
| DE000PH5GQD9 | 37,43 | 0,388 | 400.000 |
| DE000PH5GQE7 | 37,87 | 0,369 | 400.000 |
| DE000PH5GQF4 | 29,36 | 0,294 | 400.000 |
| DE000PH5GQG2 | 32,44 | 0,334 | 400.000 |
| DE000PH5GQH0 | 35,51 | 0,371 | 400.000 |
| DE000PH5GQJ6 | 41,63 | 0,448 | 400.000 |
| DE000PH5GQK4 | 27,73 | 0,272 | 400.000 |
| DE000PH5GQL2 | 30,74 | 0,317 | 400.000 |
| DE000PH5GQM0 | 33,74 | 0,357 | 400.000 |
| DE000PH5GQN8 | 39,70 | 0,451 | 400.000 |
| DE000PH5GQP3 | 29,15 | 0,292 | 400.000 |
| DE000PH5GQQ1 | 32,07 | 0,343 | 400.000 |
| DE000PH5GQR9 | 34,97 | 0,381 | 400.000 |
| DE000PH5GQS7 | 40,71 | 0,486 | 400.000 |
| DE000PH5GQT5 | 46,42 | 0,601 | 400.000 |
| DE000PH5GQU3 | 27,63 | 0,273 | 400.000 |
| DE000PH5GQV1 | 30,51 | 0,32 | 400.000 |
| DE000PH5GQW9 | 33,33 | 0,362 | 400.000 |

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 Angebots-
bedingungen 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

S&P 500® 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 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 hiervon 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

| | |
|---|--|
| Bezeichnung und Wertpapierkennnummern: | Capped Bonus / Capped Bonus ^{PRO} Zertifikate bezogen auf Indizes (die " Wertpapiere "), ISIN: / WKN: siehe Tabelle |
| Identität und Kontaktdaten der Emittentin: | 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 |
| Zuständige Behörde: | Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (" BaFin "). Die Geschäftsadresse der BaFin (Wertpapieraufsicht) lautet: Marie-Curie-Str. 24-28, 60439 Frankfurt, Bundesrepublik Deutschland. (Telefonnummer: +49 (0) 228 41080). |
| Billigung des Basisprospekts: | 19. Februar 2021 |

Abschnitt B - Basisinformationen über die Emittentin

Wer ist die Emittentin der Wertpapiere?

| | |
|--|---|
| Sitz und Rechtsform: | Sitz der Emittentin ist Frankfurt am Main. Die Geschäftsadresse 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). |
| Haupttätigkeiten: | Emission von Wertpapieren |
| Hauptanteilseigner: | Alleinige Gesellschafterin der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH ist BNP Paribas S.A., eine börsennotierte Aktiengesellschaft nach französischem Recht. |
| Identität der Hauptgeschäftsführer: | Geschäftsführer der Emittentin sind Grégoire Toubanc und Hans Eich. |
| Identität der Abschlussprüfer: | Zum Abschlussprüfer wurde MAZARS GmbH & Co. KG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Theodor-Stern-Kai 1, 60596 Frankfurt am Main bestellt. |

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 – Nichtdividendenwerte

| | Jahresabschluss 31. Dezember 2020 in EUR | Jahresabschluss 31. Dezember 2019 in EUR |
|--|---|---|
| Ergebnis der gewöhnlichen Geschäftstätigkeit | | |
| 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 – Nichtdividendenwerte

| | Jahresabschluss 31. Dezember 2020 in EUR | Jahresabschluss 31. Dezember 2019 in EUR |
|--|---|---|
| | | |

| Forderungen und sonstige Vermögensgegenstände | | |
|--|------------------|------------------|
| 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 |
| Verbindlichkeiten | | |
| 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

| | Für den Zeitraum 1. Januar bis 31. Dezember 2020 in EUR | Für den Zeitraum 1. Januar bis 31. Dezember 2019 in EUR |
|--|--|--|
| 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 Gewinnabführungsvertrags 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^{PRO}** 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 Anpassungsereignisses 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) | Bezugsverhältnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Bewertungstag*/ Fälligkeitstag* |
| PH5GNK, DE000PH5GNK1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.400,0000 | 6.600,0000 | 6.600,0000 | 18.03.2022/ 24.03.2022 |
| PH5GNL, DE000PH5GNL9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.600,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 18.03.2022/ 24.03.2022 |
| PH5GNM, DE000PH5GNM7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 18.03.2022/ 24.03.2022 |
| PH5GNN, DE000PH5GNN5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 4.200,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 18.03.2022/ 24.03.2022 |
| PH5GNP, DE000PH5GNP0 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 20.05.2022/ 26.05.2022 |
| PH5GNQ, DE000PH5GNQ8 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 20.05.2022/ 26.05.2022 |
| PH5GNR, DE000PH5GNR6 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 20.05.2022/ 26.05.2022 |
| PH5GNS, DE000PH5GNS4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 6.800,0000 | 6.800,0000 | 17.06.2022/ 23.06.2022 |
| PH5GNT, DE000PH5GNT2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 17.06.2022/ 23.06.2022 |
| PH5GNU, DE000PH5GNU0 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 15.07.2022/ 21.07.2022 |
| PH5GNV, DE000PH5GNV8 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 15.07.2022/ 21.07.2022 |
| PH5GNW, DE000PH5GNW6 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GNX, DE000PH5GNX4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GNY, DE000PH5GNY2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GNZ, DE000PH5GNZ9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN0, DE000PH5GN00 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN1, DE000PH5GN18 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN2, DE000PH5GN26 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN3, DE000PH5GN34 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN4, DE000PH5GN42 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Bezugsverhältnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Bewertungstag*/ Fälligkeitstag* |
|--|---|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------|--|
| PH5GN5, DE000PH5GN59 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 6.600,0000 | 6.600,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN6, DE000PH5GN67 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN7, DE000PH5GN75 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN8, DE000PH5GN83 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GN9, DE000PH5GN91 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GPA, DE000PH5GPA7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GPB, DE000PH5GPB5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.800,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GPC, DE000PH5GPC3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 19.08.2022/ 25.08.2022 |
| PH5GPD, DE000PH5GPD1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.300,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPE, DE000PH5GPE9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.300,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPF, DE000PH5GPF6 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.400,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPG, DE000PH5GPG4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.400,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPH, DE000PH5GPH2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.500,0000 | 3.500,0000 | 3.500,0000 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPJ, DE000PH5GPJ8 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.500,0000 | 3.700,0000 | 3.700,0000 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPK, DE000PH5GPK6 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.700,0000 | 3.500,0000 | 3.500,0000 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPL, DE000PH5GPL4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPM, DE000PH5GPM2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.900,0000 | 3.300,0000 | 3.300,0000 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPN, DE000PH5GPN0 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 6.800,0000 | 6.800,0000 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPP, DE000PH5GPP5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.600,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 16.09.2022/ 22.09.2022 |
| PH5GPQ, DE000PH5GPQ3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.400,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPR, DE000PH5GPR1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.400,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Bezugsverhältnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Bewertungstag*/ Fälligkeitstag* |
|--|---|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|-----------------------------|--|
| PH5GPS, DE000PH5GPS9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.400,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPT, DE000PH5GPT7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.400,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPU, DE000PH5GPU5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.600,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPV, DE000PH5GPV3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.600,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPW, DE000PH5GPW1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.600,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPX, DE000PH5GPX9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.600,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPY, DE000PH5GPY7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GPZ, DE000PH5GPZ4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP0, DE000PH5GP08 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP1, DE000PH5GP16 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP2, DE000PH5GP24 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP3, DE000PH5GP32 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP4, DE000PH5GP40 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP5, DE000PH5GP57 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP6, DE000PH5GP65 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP7, DE000PH5GP73 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 6.600,0000 | 6.600,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP8, DE000PH5GP81 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GP9, DE000PH5GP99 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GQA, DE000PH5GQA5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GQB, DE000PH5GQB3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GQC, DE000PH5GQC1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.200,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |

| WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen* | Basiswert* (Index mit ISIN) | Bezugsverhältnis* | Barriere* in Indexpunkten | BonusLevel* in Indexpunkten | Cap* in Indexpunkten | Bewertungstag*/ Fälligkeitstag* |
|---|---|-------------------|---------------------------|-----------------------------|----------------------|---------------------------------|
| PH5GQD, DE000PH5GQD9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.800,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GQE, DE000PH5GQE7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 4.000,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 21.10.2022/ 27.10.2022 |
| PH5GQF, DE000PH5GQF4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.400,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQG, DE000PH5GQG2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.400,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQH, DE000PH5GQH0 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.400,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQJ, DE000PH5GQJ6 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.400,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQK, DE000PH5GQK4 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.600,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQL, DE000PH5GQL2 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.600,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQM, DE000PH5GQM0 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.600,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQN, DE000PH5GQN8 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.600,0000 | 5.000,0000 | 5.000,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQP, DE000PH5GQP3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 3.600,0000 | 3.600,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQQ, DE000PH5GQQ1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 4.000,0000 | 4.000,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQR, DE000PH5GQR9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 4.400,0000 | 4.400,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQS, DE000PH5GQS7 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 5.200,0000 | 5.200,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQT, DE000PH5GQT5 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 2.800,0000 | 6.000,0000 | 6.000,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQU, DE000PH5GQU3 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 3.400,0000 | 3.400,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQV, DE000PH5GQV1 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 3.800,0000 | 3.800,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |
| PH5GQW, DE000PH5GQW9 / 400.000 | S&P 500® Index (Kurs Index), US78378X1072 | 0,01 | 3.000,0000 | 4.200,0000 | 4.200,0000 | 18.11.2022/ 24.11.2022 |

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?

| | |
|--|--|
| Sitz und Rechtsform: | Die Garantin wurde in Frankreich als Aktiengesellschaft nach französischem Recht (société anonyme) (mit der Rechtsträgerkennung (LEI): ROMUWSFPU8MPRO8K5P83 gegründet. Ihre Hauptverwaltung hat die Anschrift 16, boulevard des Italiens - 75009 Paris, Frankreich. |
| Haupttätigkeiten: | BNP Paribas S.A. ist, nach Selbsteinschätzung, eine der führenden Banken Frankreichs und unterhält Zweigstellen und Tochtergesellschaften in allen wichtigen Märkten. |
| Hauptanteilseigner: | 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. |
| Identität der Hauptgeschäftsführer: | Jean-Laurent Bonnafé, Chief Executive Officer der BNP Paribas S.A. |
| Identität der Abschlussprüfer: | 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**

| | 31.12.2020 (geprüft) in Mio. EUR | 31.12.2019 (geprüft) in Mio. EUR | IH21 (ungeprüft) in Mio. EUR | IH20 (ungeprüft) in Mio. EUR |
|-----------------------------------|---|---|---|---|
| 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

| | 30.06.2021 (ungeprüft) in Mio. EUR | 31.12.2020 (geprüft) in Mio. EUR | 31.12.2019 (geprüft) in Mio. EUR |
|---|---|---|---|
| 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, Gegenparteiisiko 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.**

Abhängigkeit von der Kursentwicklung des Basiswerts:

Die Auswahl des Basiswerts durch die Emittentin beruht nicht zwangsläufig auf ihren Einschätzungen bezüglich der zukünftigen Wertentwicklung des ausgewählten Basiswerts. Zu beachten ist, dass eine Veränderung des Kurses des dem Wertpapier zugrundeliegenden Basiswerts dazu führen kann, dass der Auszahlungsbetrag entsprechend der Wertentwicklung des Basiswerts auch erheblich unter dem für das Wertpapier gezahlten Kaufpreis liegen und dadurch für den Wertpapierinhaber ein erheblicher Verlust in Bezug auf den für das Wertpapier gezahlten Kaufpreis entstehen kann.

Risiken im Zusammenhang mit dem Auszahlungs- bzw. Tilgungsprofil:

Abhängigkeit vom Basiswert

Wenn der für die Barrierenbetrachtung maßgebliche Kurs, die Barriere erreicht oder unterschritten hat, kann der Auszahlungsbetrag abhängig von der Entwicklung des jeweils zugrundeliegenden Basiswerts, substantiell unter den für 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 für ein Wertpapier gezahlten Kaufpreis entspricht.

Marktstörungen: Für Wertpapierinhaber besteht das Risiko, dass der Eintritt einer in den Wertpapierbedingungen beschriebenen Marktstörung den Wert der Wertpapiere nachteilig beeinflusst. Außerdem kann eine Marktstörung die Zahlung des jeweils geschuldeten Betrags verzögern.

Anpassungen, Kündigungs- und Wiederanlagerisiko: Wertpapierinhaber tragen das Risiko, dass die Wertpapiere gemäß den Wertpapierbedingungen von der Emittentin angepasst oder gekündigt werden. Im Fall einer Kündigung kann der Kündigungsbetrag auch erheblich unter dem für den Erwerb der Wertpapiere aufgewendeten Kapitalbetrag liegen. Auch ein **Totalverlust** ist möglich. Zudem sind Wertpapierinhaber dem Risiko ausgesetzt, dass sie erhaltene Beträge nur zu weniger günstigen Konditionen wieder anlegen können, 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 während der Laufzeit zum Zeitpunkt ihres Kaufs nicht fest.

Liquiditätsrisiko: Wertpapierinhaber tragen das Risiko, dass es gegebenenfalls keinen liquiden Sekundärmarkt für den Handel mit den Wertpapieren gibt und dass sie die Wertpapiere nicht zu einer bestimmten Zeit oder zu einem bestimmten Kurs verkaufen können.

Risiken im Zusammenhang mit dem Basiswert: Das Regelwerk des Index unterliegt möglichen Änderungen durch den Betreiber des Index. Die Emittentin hat keinen Einfluss auf solche etwaigen Änderungen, die unter Umständen die Zahlung an die Inhaber von Wertpapieren (negativ) beeinflussen können. Sofern es sich bei dem Basiswert um einen Preisindex (auch Kursindex genannt) handelt, ist zu beachten, dass – anders als bei Performanceindizes – Dividendenausschüttungen der im Basiswert enthaltenen Aktien nicht zu einer Erhöhung des Stands des Basiswerts führen. Anleger profitieren somit nicht von Dividenden oder sonstigen Ausschüttungen in Bezug auf die in einem Preisindex enthaltenen Aktien.

Risiken aus möglichen Interessenkonflikten: Die Emittentin, die Garantin und ihre verbundenen Unternehmen können Interessen verfolgen, die den Interessen der Wertpapierinhaber widersprechen oder diese nicht berücksichtigen. Dies kann im Zusammenhang mit der Ausübung anderer Funktionen oder bei der Durchführung weiterer Transaktionen erfolgen. Mögliche Interessenkonflikte können sich nachteilig auf den Wert der Wertpapiere auswirken.

Abschnitt D – Basisinformationen über das öffentliche Angebot von Wertpapieren und/oder die Zulassung zum Handel an einem geregelten Markt

Zu welchen Konditionen und nach welchem Zeitplan können 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 öffentliche Angebot endet mit Ablauf der Gültigkeit 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 Börse und der Börse Stuttgart ist beabsichtigt.

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

Schätzung der Gesamtkosten

Der Anleger kann die Wertpapiere zum Ausgabepreis bzw. zum Verkaufspreis erwerben. Dem Anleger werden über 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 über Banken und Sparkassen, sonstige Vertriebswege oder die jeweilige Wertpapierbörse entstehen können und über die weder die Emittentin noch die Anbieterin eine Aussage treffen können.

Der Anfängliche Ausgabepreis enthält jeweils die produktspezifischen Einstiegskosten (zum Datum der Endgültigen 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 französischem Recht (Société en Nom Collectif) gegründet.

Weshalb wird dieser Prospekt erstellt?

Im Rahmen des Angebots steht die Gewinnerzielung im Vordergrund. Die Emittentin wird den Nettoerlös der Emission ausschließlich zur Absicherung ihrer Verbindlichkeiten gegenüber den Wertpapierinhabern unter den Wertpapieren verwenden.