

CORPORATE EVENT NOTICE: Modifica delle caratteristiche del sottostante
UniCredit S.p.A.
SEDE DI NEGOZIAZIONE: Milan
DISPOSIZIONE: MIL_20240509_10808_TLX
DATA: 09/05/2024
MERCATO: EuroTLX

OGGETTO: RETTIFICA MEDIANTE APPLICAZIONE DEL K FACTOR AVENTE A OGGETTO HSBC Holdings PLC / GB0005405286 A DECORRERE DAL 10/05/2024

1. Informazioni inerenti la Corporate action

DESCRIZIONE: HSBC Holdings plc (HSBA.L) will pay a dividend of 0.10 USD per share and a special dividend of 0.21 USD per share.

DATA DI EFFICACIA: 09/05/2024

2. Dettagli sulla modalità di rettifica

MERCATO DERIVATI: ICE Futures Europe

FATTORE DI RETTIFICA: 0,97639

CRITERIO DI RETTIFICA: The adjustable product data of UniCredit SpA Certificate are changed with effective date 9th of May 2024 according to the K-Factor for the respective Basket Component.

DATA DI EFFICACIA EMITTENTE: 10/05/2024

3. Caratteristiche degli strumenti oggetto di rettifica

ISIN CODE	IT0005581902	CODICE Euronext	NSCIT5581904	MARKETING PRODUCT NAME	Cash Collect Autocallable	SEGMENTO DI NEGOZIAZIONE	EuroTLX - Certificates Investment Segment
VALORI CORRENTI				VALORI POST RETTIFICA			
STRIKE				STRIKE			
PARITY				PARITY			
LOWER BARRIER LEVEL				LOWER BARRIER LEVEL			
UPPER BARRIER LEVEL				UPPER BARRIER LEVEL			
INITIAL VALUE				INITIAL VALUE			

CAP		CAP	
FLOOR		FLOOR	
STRIKE INFO	666,5	STRIKE INFO	650,7639
LOWER BARRIER LEVEL INFO		LOWER BARRIER LEVEL INFO	
UPPER BARRIER LEVEL INFO		UPPER BARRIER LEVEL INFO	
NOTE			

Il presente avviso ed il suo contenuto sono forniti solo a scopo informativo per facilitare il funzionamento equo, ordinato ed efficiente del mercato e non costituiscono una sollecitazione ad intraprendere attività di investimento.

Il contenuto del presente avviso è fornito "as is" sulla base delle informazioni fornite al gestore del mercato, senza rappresentazioni o garanzie di alcun tipo. Euronext non potrà essere ritenuta responsabile per eventuali perdite o danni di qualsiasi natura derivanti dall'aver utilizzato, fatto affidamento o dall'aver agito in base alle informazioni fornite. Nessuna informazione riportata, o alla quale si fa riferimento nel presente avviso, potrà costituire la base di un contratto. La costituzione di diritti ed obblighi in relazione ai prodotti finanziari negoziati nelle borse gestite dalle filiali di Euronext dipenderà esclusivamente dalle regole applicabili del gestore del mercato.

I Mercati Euronext comprendono i mercati gestiti da Borsa Italiana, Euronext Amsterdam, Euronext Bruxelles, Euronext Dublino, Euronext Lisbona, Euronext Parigi, MTS e Oslo Børs, indicati rispettivamente come mercati di Milano, Amsterdam, Bruxelles, Dublino, Lisbona, Parigi, MTS e Oslo, a seconda dei casi.

Euronext si riferisce a Euronext N.V. e alle sue affiliate. Le informazioni relative ai marchi e ai diritti di proprietà intellettuale di Euronext sono disponibili all'indirizzo www.euronext.com/terms-use.

©2023, Euronext N.V. - Tutti i diritti sono riservati.

CORPORATE EVENT NOTICE: Change of underlying characteristics
UniCredit S.p.A.
LOCATION: Milan
NOTICE: MIL_20240509_10808_TLX
DATE: 09/05/2024
MARKET: EuroTLX

OBJECT: K FACTOR ADJUSTMENT RELATED TO HSBC Holdings PLC / GB0005405286 WITH EFFECTIVE DATE AS OF 10/05/2024

1. General information about the corporate action

DESCRIPTION: HSBC Holdings plc (HSBA.L) will pay a dividend of 0.10 USD per share and a special dividend of 0.21 USD per share.

EFFECTIVE DATE: 09/05/2024

2. Adjustment details

DERIVATIVE MARKET: ICE Futures Europe

ADJUSTMENT FACTOR: 0,97639

ADJUSTMENT CRITERIA: The adjustable product data of UniCredit SpA Certificate are changed with effective date 9th of May 2024 according to the K-Factor for the respective Basket Component.

ISSUER ADJUSTMENT EFFECTIVE DATE:10/05/2024

3. Features of adjusted financial instruments

ISIN CODE	IT0005581902	EURONEXT CODE	NSCIT5581904	MARKETING PRODUCT NAME	Cash Collect Autocallable	OFFICIAL SEGMENT	EuroTLX - Cert-X - Investment Certificates Segment
CURRENT VALUES				NEW VALUES POST ADJUSTMENT			
STRIKE				STRIKE			
PARITY				PARITY			
LOWER BARRIER LEVEL				LOWER BARRIER LEVEL			
UPPER BARRIER LEVEL				UPPER BARRIER LEVEL			

INITIAL VALUE		INITIAL VALUE	
CAP		CAP	
FLOOR		FLOOR	
STRIKE INFO	666,5	STRIKE INFO	650,7639
LOWER BARRIER LEVEL INFO		LOWER BARRIER LEVEL INFO	
UPPER BARRIER LEVEL INFO		UPPER BARRIER LEVEL INFO	
NOTES			

The present notice and the contents thereof are only provided for information purposes to facilitate the fair, orderly and efficient functioning of the market and is not a recommendation to engage in investment activities.

The contents of this notice are provided "as is" based on information provided to the market operator without representation or warranty of any kind. Euronext will not be held liable for any loss or damages of any nature ensuing from using, trusting, or acting on information provided. No information set out or referred to in this notice shall form the basis of any contract. The creation of rights and obligations in respect of financial products that are traded on the exchanges operated by Euronext's subsidiaries shall depend solely on the applicable rules of the market operator.

The Euronext Markets comprise the markets operated by Borsa Italiana, Euronext Amsterdam, Euronext Brussels, Euronext Dublin, Euronext Lisbon, Euronext Paris, MTS, and Oslo Børs, referred to respectively as the Milan, Amsterdam, Brussels, Dublin, Lisbon, Paris, MTS, and Oslo markets, as relevant.

Euronext refers to Euronext N.V. and its affiliates. Information regarding trademarks and intellectual property rights of Euronext is located at www.euronext.com/terms-use.

©2023, Euronext N.V. - All rights reserved