

OBJECT: ADJUSTMENTS ON MEDIASET S.P.A. UNDERLYING

GENERAL INFORMATION ABOUT THE CORPORATE ACTION

DESCRIPTION	MEDIASET S.P.A. ha annunciato la distribuzione di un dividendo straordinario pari a € 0.30 per ciascuna azione ordinaria MEDIASET detenuta (si vedano avvisi di Borsa Italiana n. 16032 e n. 16145).
Underlying ISIN Code	IT0001063210
Underlying Name	MEDIASET S.P.A.
EFFECTIVE DATE	19/07/2021

DETAILS ABOUT THE ADJUSTMENT

ADJUSTMENT CRITERIA	Si comunica che al fine di mantenere invariata la posizione degli investitori dei Certificati emessi da UniCredit Bank AG su MEDIASET (MS.MI), in accordo con quanto stabilito dal Prospetto di Base, i valori di Strike e le caratteristiche degli strumenti applicabili vengono rettificati come indicato nella Tabella seguente, in base al coefficiente di rettifica pari a 0.904276, si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 24461 del 16 Luglio 2021.
DERIVATIVE MARKET	IDEM

ADJUSTMENT FACTOR

0.904276

FEATURES OF ADJUSTED FINANCIAL INSTRUMENTS

ADJUSTMENT EFFECTIVE DATE 19/07/2021

INVESTMENT CERTIFICATES SINGLE SHARE

Cod Isin	Underlying	Strike Old	Strike	First Barrier Old	First Barrier	Initial Value Old	Initial Value	Second Barrier Old	Second Barrier	Note Info
DE000HV4EPY 7	MEDIASET S.P.A.	1.762	1.5933	2.2025		1.762	1.5933			Barrier breached 04/12/2020
DE000HV4G96 4	MEDIASET S.P.A.	1.855	1.6774	1.2985	1.1742	1.855	1.6774			
DE000HV4JQD 8	MEDIASET S.P.A.	2.082	1.8827	1.4574	1.3179	2.082	1.8827			
DE000HV4JQX 6	MEDIASET S.P.A.	2.082	1.8827	1.5615	1.412	2.082	1.8827			
DE000HV4JR6 9	MEDIASET S.P.A.	2.082	1.8827	1.4574	1.3179	2.082	1.8827			
DE000HV4L86 5	MEDIASET S.P.A.	2.64	2.3873	3.432	3.1035	2.64	2.3873			

Cod Isin	Underlying	Strike Old	Strike	First Barrier Old	First Barrier	Initial Value Old	Initial Value	Second Barrier Old	Second Barrier	Note Info
DE000HV41LG 4	MEDIASET S.P.A.	2.497	2.258	2.2473	2.0322	2.497	2.258	1.8728	1.6935	

OBJECT: ADJUSTMENTS ON MEDIASET S.P.A. UNDERLYING

GENERAL INFORMATION ABOUT THE CORPORATE ACTION

DESCRIPTION	MEDIASET S.P.A. ha annunciato la distribuzione di un dividendo straordinario pari a € 0.30 per ciascuna azione ordinaria MEDIASET detenuta (si vedano avvisi di Borsa Italiana n. 16032 e n. 16145).
Underlying ISIN Code	IT0001063210
Underlying Name	MEDIASET S.P.A.
EFFECTIVE DATE	19/07/2021

DETAILS ABOUT THE ADJUSTMENT

ADJUSTMENT CRITERIA	Si comunica che al fine di mantenere invariata la posizione degli investitori dei Turbo Open End emessi da UniCredit Bank AG su MEDIASET (MS.MI), in accordo con quanto stabilito dal Prospetto di Base, i valori di Strike e le caratteristiche degli strumenti applicabili vengono rettificati come indicato nella Tabella seguente, in base al coefficiente di rettifica pari a 0.904276, si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 24461 del 16 Luglio 2021.
DERIVATIVE MARKET	IDEM

ADJUSTMENT FACTOR

0.904276

FEATURES OF ADJUSTED FINANCIAL INSTRUMENTS

ADJUSTMENT EFFECTIVE DATE 19/07/2021

LEVERAGE CERTIFICATES SINGLE SHARE

Cod Isin	Underlying	Parity Old	Parity	Strike Old	Strike	First Barrier Old	First Barrier
DE000HV4HR12	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	1.8468	1.67005	1.846837	1.67005
DE000HV4JJ77	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	1.9905	1.799992	1.990534	1.799992
DE000HV4KHR5	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	2.1328	1.928631	2.13279	1.928631
DE000HV4L4W4	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	2.2793	2.061146	2.279333	2.061146
DE000HV8BSL5	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	3.5857	3.24249	3.58573	3.24249
DE000HV8B6R7	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	2.4122	2.181302	2.412208	2.181302
DE000HV8B6S5	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	2.4876	2.249472	2.487594	2.249472

Cod Isin	Underlying	Parity Old	Parity	Strike Old	Strike	First Barrier Old	First Barrier
DE000HV8B6T3	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	2.563	2.317645	2.562984	2.317645
DE000HV8B6U1	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	2.6384	2.385807	2.638362	2.385807
DE000HV8B6V9	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	3.3473	3.026866	3.347281	3.026866
DE000HV8B6W7	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	3.4217	3.094131	3.421667	3.094131
DE000HV8B6X5	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	3.496	3.161388	3.496043	3.161388
DE000HV8C352	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	2.78	2.51385	2.779959	2.51385
DE000HV8C360	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	3.6643	3.313579	3.664345	3.313579
DE000HV8C378	MEDIASET S.P.A.	1	1.105857	3.7391	3.381207	3.739132	3.381207

OBJECT: ADJUSTMENTS ON MEDIASET S.P.A. UNDERLYING

GENERAL INFORMATION ABOUT THE CORPORATE ACTION

DESCRIPTION	MEDIASET S.P.A. ha annunciato la distribuzione di un dividendo straordinario pari a € 0.30 per ciascuna azione ordinaria MEDIASET detenuta (si vedano avvisi di Borsa Italiana n. 16032 e n. 16145).
Underlying ISIN Code	IT0001063210
Underlying Name	MEDIASET S.P.A.
EFFECTIVE DATE	19/07/2021

DETAILS ABOUT THE ADJUSTMENT

ADJUSTMENT CRITERIA	Si comunica che al fine di mantenere invariata la posizione degli investitori dei Certificati emessi da UniCredit Bank AG su MEDIASET (MS.MI), in accordo con quanto stabilito dal Prospetto di Base, i valori di Strike e le caratteristiche degli strumenti applicabili vengono rettificati come indicato nella Tabella seguente, in base al coefficiente di rettifica pari a 0.904276, si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 24461 del 16 Luglio 2021.
DERIVATIVE MARKET	IDEM

ADJUSTMENT FACTOR

0.904276

FEATURES OF ADJUSTED FINANCIAL INSTRUMENTS

ADJUSTMENT EFFECTIVE DATE 19/07/2021

INVESTMENT CERTIFICATES SINGLE SHARE

Cod Isin	Underlying	Strike Old	Strike	Barrier1 Info Old	Barrier1 Info
DE000HV4ED60	MEDIASET S.P.A.	1.846	1.6693	1.1999	1.085

OBJECT: ADJUSTMENTS ON MEDIASET S.P.A. UNDERLYING

GENERAL INFORMATION ABOUT THE CORPORATE ACTION

DESCRIPTION	MEDIASET S.P.A. ha annunciato la distribuzione di un dividendo straordinario pari a € 0.30 per ciascuna azione ordinaria MEDIASET detenuta (si vedano avvisi di Borsa Italiana n. 16032 e n. 16145).
Underlying ISIN Code	IT0001063210
Underlying Name	MEDIASET S.P.A.
EFFECTIVE DATE	19/07/2021

DETAILS ABOUT THE ADJUSTMENT

ADJUSTMENT CRITERIA	Si comunica che al fine di mantenere invariata la posizione degli investitori dei Covered Warrant emessi da UniCredit Bank AG su MEDIASET (MS.MI), in accordo con quanto stabilito dal Prospetto di Base, i valori di Strike e le caratteristiche degli strumenti applicabili vengono rettificati come indicato nella Tabella seguente, in base al coefficiente di rettifica pari a 0.904276, si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 24461 del 16 Luglio 2021.
DERIVATIVE MARKET	IDEM

ADJUSTMENT FACTOR

0.904276

FEATURES OF ADJUSTED FINANCIAL INSTRUMENTS

ADJUSTMENT EFFECTIVE DATE 19/07/2021

PLAIN VANILLA SINGLE SHARE

Cod Isin	Underlying	Parity Old	Parity	Strike Old	Strike
DE000HV4HYG9	MEDIASET S.P.A.	0.1	0.1106	1.8	1.6277
DE000HV4JMS5	MEDIASET S.P.A.	0.1	0.1106	2.4	2.1703
DE000HV4KQE4	MEDIASET S.P.A.	0.1	0.1106	2.2	1.9894
DE000HV4LB63	MEDIASET S.P.A.	0.1	0.1106	3.2	2.8937
DE000HV4LB71	MEDIASET S.P.A.	0.1	0.1106	2.4	2.1703
DE000HV4LND1	MEDIASET S.P.A.	0.1	0.1106	3.2	2.8937
DE000HV8C154	MEDIASET S.P.A.	0.1	0.1106	3	2.7128

