

# Aktienanleihe

auf den Taiwan Semiconductor Manufacturing. Co. Ltd. ADR (Quanto)  
Ein Produkt der UniCredit Bank GmbH, München  
ISIN DE000HV4XUU5

Stand 21.06.2024

## FESTE ZINSEN SICHERN!

Sie wünschen sich feste Zinszahlungen und sind von der Entwicklung des Taiwan Semiconductor Manufacturing. Co. Ltd. ADR überzeugt? Dann könnte sich ein Blick auf die **Aktienanleihe** der UniCredit Bank GmbH lohnen.

## DAS BESONDERE

- 11,90 % p. a. Zinszahlung am jeweiligen Zinszahlungstag.
- Basispreis liegt bei 90 % vom Referenzpreis am anfänglichen Beobachtungstag.
- Beachten Sie die „Risiken“ & „Weitere Hinweise“ auf S. 3.

## SO FUNKTIONIERT'S!

Am anfänglichen Beobachtungstag wird der Schlusskurs (Referenzpreis) des Basiswertes des Taiwan Semiconductor Manufacturing. Co. Ltd. ADR (American Depositary Receipt) festgestellt. Davon wird der Basispreis (90 % vom Referenzpreis) berechnet.

Liegt der Referenzpreis des Basiswertes am letzten Beobachtungstag auf oder über dem Basispreis, erfolgt die Rückzahlung der Anleihe zu EUR 1.000,-.

Liegt der Referenzpreis des Basiswertes am letzten Beobachtungstag unter dem Basispreis, erfolgt die Rückzahlung durch Lieferung von American Depositary Receipts (ADRs) der Taiwan Semiconductor Manufacturing. Co. Ltd. in festgelegter Anzahl (Bezugsverhältnis). Diese errechnet sich wie folgt: Nennbetrag multipliziert mit dem Wechselkurs (EUR/USD) am letzten Beobachtungstag, geteilt durch den Basispreis. Ein etwaiger Bruchteil des Basiswertes wird in Euro ausgezahlt: Bruchteil des Basiswertes multipliziert mit dem Referenzpreis am letzten Beobachtungstag, geteilt durch den Wechselkurs (EUR/USD) am letzten Beobachtungstag. Hierbei entsteht ein Verlust.

Die Anleihe hat eine Währungsabsicherung, d. h. das Bezugsverhältnis bzw. ein etwaiger Bruchteil des Basiswertes werden um den Wechselkurs bereinigt (Quanto).

Unabhängig von der Basiswertentwicklung gibt es an jedem Zinszahlungstag eine Zinszahlung in Höhe von 11,90 % p. a.

Insgesamt ist Ihr Kapital 9 Monate investiert, wobei Sie die Anleihe unter normalen Marktbedingungen börslich und außerbörslich veräußern können.

<b>KATEGORIE</b>	➤ Anlageprodukt ohne Kapitalschutz
<b>ANLAGEBEREICH</b>	➤ Aktien/Taiwan
<b>MARKTERWARTUNG DES ANLEGERERS</b>	➤ Leicht steigend

## DER BASISWERT

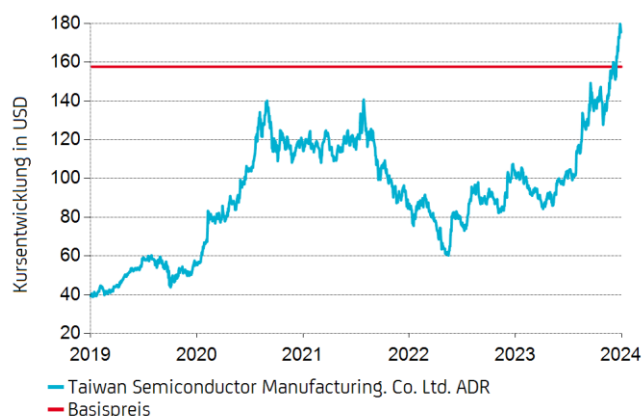
Die Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited mit Sitz in Hsinchu, ist ein taiwanesischer Halbleiterhersteller. Das Unternehmen fertigt Halbleiter u. a. für High Performance Computing, Smartphones, die Automobilindustrie und die Unterhaltungsindustrie.

Quelle: Internetseite Taiwan Semiconductor Manufacturing. Co. Ltd.

## RÜCKZAHLUNG AM LAUFZEITENDE

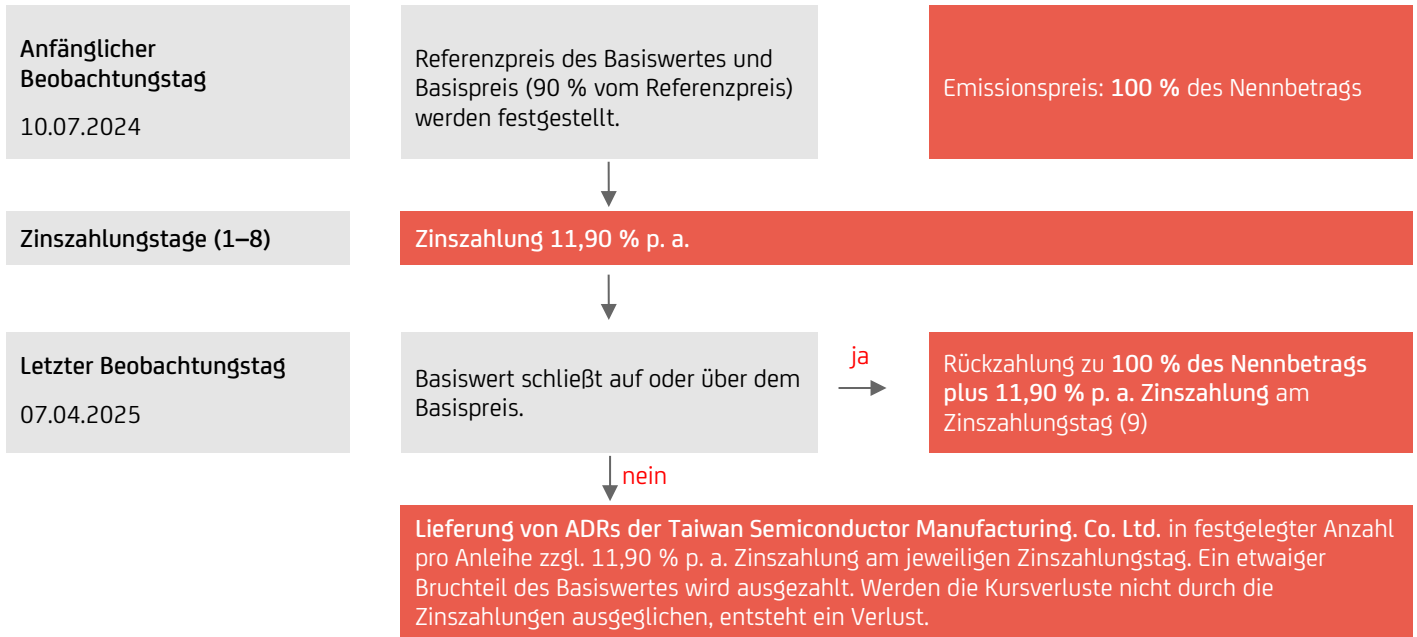
Wenn der Kurs des Basiswertes am letzten Beobachtungstag auf oder über dem Basispreis schließt, erfolgt die Rückzahlung der Anleihe zu EUR 1.000,-. Wird der Basispreis am letzten Beobachtungstag unterschritten, entsteht ein Verlust.

## HISTORISCHE KURSENTWICKLUNG



Dargestellter Zeitraum: 21.06.2019 – 20.06.2024. Quelle: SIX Financial Information. Die dargestellten Werte beziehen sich auf den Stand vom 20.06.2024. Die tatsächlichen Werte werden jedoch erst am 10.07.2024 festgestellt. Historische Betrachtungen stellen keinen verlässlichen Indikator für zukünftige Entwicklungen dar.

## DIE FUNKTIONSWEISE



## SO KÖNNTE DIE ZUKUNFT AUSSEHEN

Folgende Beispiele verdeutlichen die mögliche Entwicklung einer Anleihe (Nennbetrag EUR 1.000,-). Es wurden ein beispielhafter Referenzpreis am anfänglichen Beobachtungstag von USD 175,- und ein Basispreis von USD 157,50 angenommen.

### MÖGLICHE SZENARIEN

Referenzpreis am letzten Beobachtungstag	Rückzahlung pro Aktienanleihe	Zinszahlung am jeweiligen Zinszahlungstag
USD 173,25	EUR 1.000,-	11,90 % p. a.
USD 157,50	EUR 1.000,-	11,90 % p. a.
USD 47,25	Lieferung von ADRs der Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. in festgelegter Anzahl (entspricht einem Gesamtwert von rund EUR 300,-).	11,90 % p. a.

Die Szenarien berücksichtigen nicht die auf Seite 4 genannten Kosten und lassen als lediglich beispielhafte Betrachtung keine Rückschlüsse auf die tatsächliche Wertentwicklung der Anlage zu.

## VORTEILE

- 11,90 % p. a. Zinszahlung am jeweiligen Zinszahlungstag.
- Basispreis liegt bei 90 % vom Referenzpreis am anfänglichen Beobachtungstag.
- Die Anleihe kann unter normalen Marktbedingungen börslich und außerbörslich veräußert werden.

## RISIKEN

- Der Anleger trägt sowohl während der Laufzeit als auch am Laufzeitende ein Kursrisiko. Liegt der Referenzpreis am letzten Beobachtungstag unter dem Basispreis, wird eine festgelegte Anzahl ADRs des Basiswertes geliefert. Deren Wert liegt in Summe unter dem Emissionspreis der Anleihe. Werden die Kursverluste nicht durch die Zinszahlungen ausgeglichen, entsteht für den Anleger ein Verlust. Ungünstigster Fall: Abgesehen von den Zinszahlungen, Totalverlust des eingesetzten Kapitals.
- Der Emittent kann die Anleihe bei Eintritt eines außerordentlichen Ereignisses mit sofortiger Wirkung kündigen. Ein außerordentliches Ereignis liegt beispielsweise vor, wenn die Kursnotierung des Basiswertes ohne geeigneten Ersatz eingestellt wird, die Kursnotierung des Basiswertes nicht länger in der ursprünglichen Währung erfolgt, wenn Rechtsänderungen eintreten oder wenn derivative Finanzinstrumente, die sich auf den Basiswert beziehen von ihrer festlegenden Terminbörse, an der sie gehandelt werden, vorzeitig gekündigt werden. In diesem Fall erfolgt die Rückzahlung zu dem vom Emittenten festgestellten Marktwert. Die Höhe dieses Marktwertes wird vom Emittenten gemäß den Bestimmungen in den Endgültigen Bedingungen der Anleihe berechnet. Der Marktwert kann auch erheblich unter dem Emissionspreis liegen, sogar ein Totalverlust ist möglich. Zudem trägt der Anleger das Risiko, dass zu einem für ihn ungünstigen Zeitpunkt gekündigt wird und er den Rückzahlungsbetrag nur zu schlechteren Bedingungen wieder anlegen kann.
- Während der Laufzeit anfallende Dividenden stehen der Finanzierung des Ertragsmechanismus zur Verfügung und werden nicht an den Anleger ausgeschüttet. Dividendenzahlungen führen beim Basiswert zu einem Kursabschlag, was sich negativ auf den Preis der Anleihe auswirkt und zum Unterschreiten des Basispreises führen kann.
- Die Anleihe ist während der Laufzeit Markteinflüssen – wie z. B. Kursentwicklung des Basiswertes, Volatilität (Kennzahl für die Häufigkeit und Intensität von Preisschwankungen eines Basiswertes; auf der Grundlage von prognostizierten Preisen des Basiswertes errechnet), Dividendenerwartung, Zinsniveau, Restlaufzeit und Bonitätseinschätzung des Emittenten – unterworfen. Verluste sind möglich. Der Kurs der Anleihe wird sich während der Laufzeit nicht auf dem Rückzahlungsprofil bewegen und kann deutlich davon abweichen. Dieses hat nur zum Laufzeitende Gültigkeit.
- Anleger sind dem Risiko ausgesetzt, dass der Emittent seine Verpflichtungen aus der Anleihe nicht erfüllen kann, beispielsweise im Falle einer Insolvenz (Zahlungsunfähigkeit/Überschuldung) oder einer behördlichen Anordnung. Ein Totalverlust des eingesetzten Kapitals ist möglich. Die Anleihe unterliegt als Schuldverschreibung keiner Einlagensicherung.

- Sollte es zu einer physischen Lieferung des Basiswertes kommen, dessen Handelswährung nicht der Heimatwährung des Anlegers entspricht, kann es nach Lieferung dieses Basiswertes zu Wechselkursrisiken kommen.
- Der Basiswert ist ein American Depository Receipt (ADR). Als ADRs werden auf Dollar lautende, von amerikanischen Depotbanken in Amerika ausgegebene Anteilscheine bezeichnet, die eine bestimmte Anzahl hinterlegter Originalaktien eines ausländischen Unternehmens verkörpern und an ihrer Stelle am amerikanischen Kapitalmarkt wie Aktien gehandelt werden. Die Anteilscheine sind an die Entwicklung der Originalaktien geknüpft. Rechtlicher Eigentümer des zugrunde liegenden Aktienbestands ist die Depotbank, die zugleich Ausgabestelle ist. ADRs weisen im Vergleich zu Aktien weitergehende Risiken auf. Unter anderem hat der Inhaber der ADRs das Risiko, im Fall einer Insolvenz der Depotbank bzw. im Fall von Zwangsvollstreckungsmaßnahmen gegen diese, seine Rechte an den zugrunde liegenden Aktien zu verlieren. Die ADRs werden infolge dessen wertlos. Ein weiteres Risiko bei ADRs ist das Wechselkursrisiko. Wertet die Währung der Originalaktien auf, kann der Kurs in ADRs in US-Dollar fallen.

## WEITERE HINWEISE

- Die Ertragschance ist auf die Zinszahlungen in Höhe von 11,90 % p. a. bezogen auf den Nennbetrag pro Anleihe und Zinszahlungstag begrenzt.
- Bei Kauf und Verkauf der Anleihe während der Laufzeit wird der Zinssatz als Stückzins ausgewiesen.
- Die Anleihe kann in der Regel börslich oder außerbörslich gekauft oder verkauft werden (ab Börsennotierung bis zum letzten Börsenhandelstag). Der Emittent beabsichtigt, für die Anleihe unter normalen Marktbedingungen fortlaufend Verkaufspreise (Briefkurse) bzw. Ankaufspreise (Geldkurse) zu stellen. Der Emittent bestimmt die An- und Verkaufspreise mittels marktüblicher Preisbildungsmodelle unter Berücksichtigung der marktpreisbestimmenden Faktoren. Der Preis kommt anders als beim Börsenhandel z. B. von Aktien nicht unmittelbar durch Angebot und Nachfrage zustande. In außergewöhnlichen Marktsituationen oder bei technischen Störungen kann ein Kauf bzw. Verkauf der Anleihe erschwert oder nicht möglich sein.
- Die Anleihe unterliegt deutschem Recht.
- Alle Ertrags- und Zinssatzangaben beziehen sich auf den Nennbetrag von EUR 1.000,-. Mit einer Investition können Kosten wie z. B. Ausgabeaufschlag, Depotentgelt sowie Erwerbs- und Veräußerungskosten verbunden sein, welche sich ertragsmindernd auswirken. Die genaue Höhe können Sie bei Ihrer Bank erfragen. Exemplarische Werte finden Sie in der Tabelle „Zahlen, Daten, Fakten“.
- Mögliche (Rück-) Zahlungen aus dem Produkt schützen Investoren möglicherweise nicht gegen ein Inflationsrisiko. Es kann also nicht zugesichert werden, dass die Kaufkraft des investierten Kapitals von einem allgemeinen Anstieg der Konsumgüterpreise unberührt bleibt.

## ZAHLEN, DATEN, FAKTEN

Name	Aktienanleihe auf den Taiwan Semiconductor Manufacturing. Co. Ltd. ADR (Quanto)
Emittent (Herausgeber der Anleihe)	UniCredit Bank GmbH, München. Aktuelle Informationen zur Bonitätseinschätzung (Rating) der UniCredit Bank GmbH finden Sie unter <a href="http://www.onemarkets.de">www.onemarkets.de</a> (Investor Relations).
Anzuwendendes Recht	Diese Anleihe unterliegt deutschem Recht.
Währung der Anleihe	Euro (EUR)
Basiswert (Bezugswert, welcher der Anleihe zugrunde liegt)	Taiwan Semiconductor Manufacturing. Co. Ltd. ADR, ISIN US8740391003, notiert in US-Dollar
Währungsabsicherung	Ja (Quanto)
Zeichnungsfrist	24.06. – 09.07.2024 (14.00 Uhr), vorbehaltlich einer vorzeitigen Schließung
Anfänglicher Beobachtungstag	10.07.2024
Emissionstag	12.07.2024
Letzter Beobachtungstag	07.04.2025
Rückzahlungstermin	14.04.2025
Zinszahlungstage	14.08.2024 (1), 14.09.2024 (2), 14.10.2024 (3), 14.11.2024 (4), 14.12.2024 (5), 14.01.2025 (6), 14.02.2025 (7), 14.03.2025 (8), 14.04.2025 (9)
Emissionspreis	100 % des Nennbetrags
Nennbetrag (kleinste handelbare Einheit)	EUR 1.000,-
Referenzpreis	Offizieller Schlusskurs des Basiswertes an der maßgeblichen Börse
Maßgebliche Börse	New York Stock Exchange
Basispreis	90 % vom Referenzpreis am anfänglichen Beobachtungstag
Zinssatz p. a.	11,90 % bezogen auf den Nennbetrag
Verzinsung	Die Aktienanleihe wird ab dem Emissionstag (einschließlich) bis zum ersten Zinszahlungstag (ausschließlich) verzinst. Anschließend erfolgt die Verzinsung jeweils vom Zinszahlungstag (einschließlich) bis zum nächsten Zinszahlungstag (ausschließlich).
Zinsmethode / Geschäftstagsregelung	Jeder Monat und jedes Jahr werden taggenau berechnet. Fällt der Zinszahlungstag auf einen Nichtbankarbeitstag, dann erfolgt die Zinsberechnung nur bis zum Nichtbankarbeitstag. Die Zinszahlung erfolgt am nächsten Bankarbeitstag.
Bezugsverhältnis	Nennbetrag multipliziert mit dem maßgeblichen Wechselkurs (EUR/USD). Das Ergebnis wird durch den Basispreis geteilt. Ein etwaiger Bruchteil des Basiswertes wird in Euro ausgezahlt (Basiswertbruchteil multipliziert mit dem Referenzpreis am letzten Beobachtungstag, geteilt durch den maßgeblichen Wechselkurs (EUR/USD)).
Maßgeblicher Wechselkurs	Offizielles Fixing des EUR/USD-Wechselkurses am letzten Beobachtungstag (Bloomberg: <a href="https://www.bloomberg.com/markets/currencies/fix-fixings">https://www.bloomberg.com/markets/currencies/fix-fixings</a> ).
Börsennotierung	Voraussichtlich ab 12.07.2024, Frankfurt (Freiverkehr), Stuttgart (Freiverkehr), München (Freiverkehr)
Letzter Börsenhandelstag	Voraussichtlich am 04.04.2025
WKN, ISIN	HV4XUU, DE000HV4XUU5

## KOSTEN

	Der Emissionspreis der Anleihe basiert auf internen Preismodellen des Emittenten. Er kann neben einer Vertriebsvergütung (wenn nachfolgend aufgeführt) auch eine erwartete Marge beinhalten, die beim Emittenten verbleibt.
Vertriebsvergütung	Die eigene Vertriebsabteilung bzw. der Vertriebspartner erhält von der UniCredit Bank GmbH als einmalige Vertriebsvergütung 1,25 % des Nennbetrags.
Erwerbskosten	Der Erwerb erfolgt zum Emissionspreis. Es fallen keine weiteren Erwerbskosten an.
	Die nachfolgenden Kosten sind Standardpreise der UniCredit Bank GmbH und können je nach gewähltem Depotmodell und Vertriebsweg abweichen. Bitte entnehmen Sie die für Ihr Depotmodell geltenden Preise dem jeweils aktuellen Preis- und Leistungsverzeichnis <a href="http://hvb.de/preis-leistung">hvb.de/preis-leistung</a> der UniCredit Bank GmbH.
Veräußerungskosten	Das Geschäft wird zwischen dem Anleger und der UniCredit Bank GmbH zu einem festen oder bestimmbareren Preis vereinbart (Festpreisgeschäft). Andernfalls wird das Geschäft von der UniCredit Bank GmbH mit einem Dritten für den Anleger abgeschlossen (Kommissionsgeschäft). Das Transaktionsentgelt in Höhe von 0,50 % vom Kurswert (mind. EUR 30,-) sowie die Ausführungspauschale (abhängig vom jeweiligen Ausführungsplatz, siehe Preis- und Leistungsverzeichnis) werden in der Wertpapierabrechnung gesondert ausgewiesen.
Laufende Kosten	Für die Verwahrung der Wertpapiere fallen für den Anleger die mit der UniCredit Bank GmbH vereinbarten Kosten an (Depotpreis). Depotpreis: 0,20 % p. a. vom Kurswert. Grundpreis pro Depot EUR 4,- pro Monat inkl. MwSt.


## NOCH FRAGEN?

Unser Experten-Team steht Ihnen gerne zur Verfügung:

 E-Mail: [onemarkets@unicredit.de](mailto:onemarkets@unicredit.de)

Weitere Informationen erhalten Sie auch unter:

 [www.onemarkets.de](http://www.onemarkets.de) bzw. [www.onemarkets.at](http://www.onemarkets.at)

 InfoLine: +49 89 378-17466

Anleger, die das Produkt gezeichnet haben, können hier einen speziellen Informationsdienst in Anspruch nehmen, der fortlaufend Informationen über die Eigenschaften des Produkts und seine Wertentwicklung bietet.

Bitte beachten Sie: Die Informationen werden bereitgestellt von der UniCredit Bank GmbH, Arabellastr. 12, D-81925 München und stellen keine Anlageberatung, sondern eine Werbung dar. Das öffentliche Angebot erfolgt ausschließlich auf Grundlage eines Wertpapierprospekts, der von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) gebilligt wurde. Die Billigung des Prospektes ist nicht als Empfehlung zu verstehen, diese Wertpapiere der UniCredit Bank GmbH zu erwerben. Allein maßgeblich sind der Prospekt einschließlich etwaiger Nachträge und die Endgültigen Bedingungen. Diese können Sie bei der UniCredit Bank GmbH, Abteilung 8951MCC, Arabellastr. 12, D-81925 München, anfordern oder unter [www.onemarkets.de/basisprospekte](http://www.onemarkets.de/basisprospekte) bzw. [www.onemarkets.de/DE000HV4XUU5](http://www.onemarkets.de/DE000HV4XUU5) herunterladen. Es wird empfohlen, diese Dokumente vor jeder Anlageentscheidung aufmerksam zu lesen, um die potenziellen Risiken und Chancen bei der Entscheidung für eine Anlage vollends zu verstehen. Zusätzlich ist für dieses Produkt unter [www.onemarkets.de/KID/DE000HV4XUU5](http://www.onemarkets.de/KID/DE000HV4XUU5) ein Basisinformationsblatt verfügbar. Sie sind im Begriff, ein Produkt zu erwerben, das nicht einfach ist und schwer zu verstehen sein kann. Diese Information richtet sich nicht an natürliche oder juristische Personen, die aufgrund ihres Wohn- bzw. Geschäftssitzes einer ausländischen Rechtsordnung unterliegen, die für die

Verbreitung derartiger Informationen Beschränkungen vorsieht. Insbesondere enthält diese Information weder ein Angebot, noch eine Aufforderung zum Kauf von Wertpapieren an Staatsbürger der USA, Großbritanniens oder der Länder im Europäischen Wirtschaftsraum, in denen die Voraussetzungen für ein derartiges Angebot nicht erfüllt sind. Die UniCredit Gruppe unterliegt der Aufsicht der Europäischen Zentralbank. Darüber hinaus untersteht die UniCredit Bank GmbH der Aufsicht der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin). Die Werbung kann Links zu Webseiten Dritter enthalten, deren Inhalte die Bank weder überprüft noch sich mit der Verweisung zu eigen macht. Daher wird für diese Inhalte keine Haftung übernommen.