Client Risk Management

Produkt Report

HVB Garant Cap Anleihe 4/2025
auf einen Infrastruktur-Aktienkorb (Quanto)
Stand 11. April 2024

Produktname	HVB Garant Cap Anleihe 4/2025 auf einen Infrastruktur-Aktienkorb (Quanto)
WKN/ISIN	HVB202/DE000HVB2027
Emissionstag	23. August 2017
Rückzahlungstermin	22. April 2025

ÜBERSICHT DER AKTUELL GÜLTIGEN PRODUKTAUSSTATTUNGSMERKMALE

Basiswert (Bezugswert, welcher der Anleihe zugrunde liegt)/ISIN	1) American Electric Power Company, Inc./US0255371017 2) Basket: 1 x Siemens AG (DE0007236101) + 0,5 x Siemens Energy (DE000ENER6Y0) 3) Basket: 1,014131338 x HOLN.S 4) Enagás S.A./ES0130960018 5) ENI S.p.A./IT0003132476 6) Geberit AG/CH0030170408 7) Iberdrola S.A./ES0144580Y14 8) Pembina Pipeline Corp/CA7063271034 9) PPL Corp/US69351T1060 10) Skanska AB Class B/SE0000113250 11) Snam S.p.A/IT0003153415 12) Southern Company/US8425871071 13) SSE PLC/GB0007908733 14) Transcanada Corp/CA87807B1076 15) Vinci S.A./FR0000125486
Referenzpreis am anfänglichen Bewertungstag	1) USD 70,358462 2) EUR 114,605385 3) CHF 46,656154 4) EUR 23,492692 5) EUR 14,649231 6) CHF 439,484615 7) EUR 6,516154 8) CAD 43,26 9) USD 31,954615 10) SEK 165,125895 11) EUR 3,897231 12) USD 47,074615 13) GBp 1.332,538462 14) CAD 59,096923 15) EUR 83,336154
Referenzpreis an den Beobachtungstagen zum Laufzeitbeginn	**1) American Electric Power Company, Inc./US0255371017** (1) USD 72,67 (21.08.2017), (2) USD 71,98 (19.09.2017), (3) USD 73,83 (19.10.2017), (4) USD 76,44 (20.11.2017), (5) USD 74,51 (19.12.2017), (6) USD 67,76 (19.01.2018), (7) USD 66,37 (20.02.2018), (8) USD 67,45 (19.03.2018), (9) USD 68,52 (19.04.2018), (10) USD 65,44 (22.05.2018), (11) USD 66,87 (19.06.2018), (12) USD 70,64 (19.07.2018), (13) USD 72,18 (20.08.2018), **2) Basket: 1 x Siemens AG (DE0007236101) + 0,5 x Siemens Energy (DE000ENER6Y0)/SIEGn_ENR1n** (1) EUR 111,10 (21.08.2017), (2) EUR 116,– (19.09.2017), (3) EUR 117,40 (19.10.2017), (4) EUR 114,85 (20.11.2017), (5) EUR 118,70 (19.12.2017), (6) EUR 123,70 (19.01.2018), (7) EUR 112,24 (20.02.2018), (8) EUR 105,36 (19.03.2018), (9) EUR 107,62 (19.04.2018), (10) EUR 117,80 (22.05.2018), (11) EUR 116,32 (19.06.2018), (12) EUR 117,98

(19.07.2018), (13) EUR 110,80 (20.08.2018),

3) Basket: 1,014131338 x HOLN.S/HOLN.S_ex_PA

(1) CHF 50,65 (21.08.2017), (2) CHF 50,93 (19.09.2017), (3) CHF 48,875 (19.10.2017), (4) CHF 47,70 (20.11.2017), (5) CHF 46,525 (19.12.2017), (6) CHF 50,44 (19.01.2018), (7) CHF 47,86 (20.02.2018), (8) CHF 45,36 (19.03.2018), (9) CHF 45,92 (19.04.2018), (10) CHF 45,85 (22.05.2018), (11) CHF 43,51 (19.06.2018), (12) CHF 40,81 (19.07.2018), (13) CHF 42,10 (20.08.2018),

4) Enagás S.A./ES0130960018

(1) EUR 24,625 (21.08.2017), (2) EUR 24,25 (19.09.2017), (3) EUR 24,13 (19.10.2017), (4) EUR 23,58 (20.11.2017), (5) EUR 24,21 (19.12.2017), (6) EUR 23,52 (19.01.2018), (7) EUR 20,51 (20.02.2018), (8) EUR 21,33 (19.03.2018), (9) EUR 23,07 (19.04.2018), (10) EUR 24,10 (22.05.2018), (11) EUR 24,61 (19.06.2018), (12) EUR 23,53 (19.07.2018), (13) EUR 23,94 (20.08.2018),

5) ENI S.p.A./IT0003132476

(1) EUR 13,19 (21.08.2017), (2) EUR 13,53 (19.09.2017), (3) EUR 13,77 (19.10.2017), (4) EUR 13,76 (20.11.2017), (5) EUR 13,98 (19.12.2017), (6) EUR 14,83 (19.01.2018), (7) EUR 13,708 (20.02.2018), (8) EUR 13,938 (19.03.2018), (9) EUR 16,– (19.04.2018), (10) EUR 16,102 (22.05.2018), (11) EUR 15,54 (19.06.2018), (12) EUR 16,08 (19.07.2018), (13) EUR 16,012 (20.08.2018),

6) Geberit AG/CH0030170408

(1) CHF 452,– (21.08.2017), (2) CHF 454,50 (19.09.2017), (3) CHF 464,40 (19.10.2017), (4) CHF 426,80 (20.11.2017), (5) CHF 425,60 (19.12.2017), (6) CHF 463,– (19.01.2018), (7) CHF 428,30 (20.02.2018), (8) CHF 429,60 (19.03.2018), (9) CHF 429,30 (19.04.2018), (10) CHF 445,40 (22.05.2018), (11) CHF 427,90 (19.06.2018), (12) CHF 432,90 (19.07.2018), (13) CHF 433,60 (20.08.2018),

7) Iberdrola S.A./ES0144580Y14

(1) EUR 6,966 (21.08.2017), (2) EUR 6,75 (19.09.2017), (3) EUR 6,684 (19.10.2017), (4) EUR 6,46 (20.11.2017), (5) EUR 6,532 (19.12.2017), (6) EUR 6,678 (19.01.2018), (7) EUR 6,15 (20.02.2018), (8) EUR 5,952 (19.03.2018), (9) EUR 6,252 (19.04.2018), (10) EUR 6,55 (22.05.2018), (11) EUR 6,566 (19.06.2018), (12) EUR 6,674 (19.07.2018), (13) EUR 6,496 (20.08.2018),

8) Pembina Pipeline Corp/CA7063271034

(1) CAD 39,26 (21.08.2017), (2) CAD 42,35 (19.09.2017), (3) CAD 41,63 (19.10.2017), (4) CAD 44,26 (20.11.2017), (5) CAD 44,75 (19.12.2017), (6) CAD 43,75 (19.01.2018), (7) CAD 41,28 (20.02.2018), (8) CAD 40,81 (19.03.2018), (9) CAD 41,53 (19.04.2018), (10) CAD 44,44 (22.05.2018), (11) CAD 45,89 (19.06.2018), (12) CAD 46,34 (19.07.2018), (13) CAD 46,09 (20.08.2018),

9) PPL Corp/US69351T1060

(1) USD 38,94 (21.08.2017), (2) USD 39,22 (19.09.2017), (3) USD 37,81 (19.10.2017), (4) USD 35,91 (20.11.2017), (5) USD 32,42 (19.12.2017), (6) USD 31,59 (19.01.2018), (7) USD 30,83 (20.02.2018), (8) USD 27,41 (19.03.2018), (9) USD 28,28 (19.04.2018), (10) USD 27,31 (22.05.2018), (11) USD 27,26 (19.06.2018), (12) USD 28,31 (19.07.2018), (13) USD 30,12 (20.08.2018),

10) Skanska AB Class B/SE0000113250

(1) SEK 175,50 (21.08.2017), (2) SEK 179,60 (19.09.2017), (3) SEK 183,60 (19.10.2017), (4) SEK 181,30 (20.11.2017), (5) SEK 171,50 (19.12.2017), (6) SEK 160,25 (19.01.2018), (7) SEK 162,95 (20.02.2018), (8) SEK 169,80 (19.03.2018), (9) SEK 160,40 (19.04.2018), (10) SEK 170,40 (22.05.2018), (11) SEK 158,60 (19.06.2018), (12) SEK 165,65 (19.07.2018), (13) SEK 166,40 (20.08.2018),

11) Snam S.p.A/IT0003153415

(1) EUR 4,038 (21.08.2017), (2) EUR 4,136 (19.09.2017), (3) EUR 4,236 (19.10.2017), (4) EUR 4,26 (20.11.2017), (5) EUR 4,136 (19.12.2017), (6) EUR 4,074 (19.01.2018), (7) EUR 3,629 (20.02.2018), (8) EUR 3,655 (19.03.2018), (9) EUR 3,823 (19.04.2018), (10) EUR 3,804 (22.05.2018), (11) EUR 3,522 (19.06.2018), (12) EUR 3,658 (19.07.2018), (13) EUR 3,693 (20.08.2018),

12) Southern Company/US8425871071

(1) USD 48,29 (21.08.2017), (2) USD 49,87 (19.09.2017), (3) USD 52,– (19.10.2017), (4) USD 51,18 (20.11.2017), (5) USD 49,81 (19.12.2017), (6) USD 44,44 (19.01.2018), (7) USD 43,47 (20.02.2018), (8) USD 44,17 (19.03.2018), (9) USD 45,60 (19.04.2018), (10) USD 43,55 (22.05.2018), (11) USD 45,06 (19.06.2018), (12) USD 47,92 (19.07.2018), (13) USD 46,61 (20.08.2018),

13) SSE PLC/GB0007908733

(1) GBp 1.431,– (21.08.2017), (2) GBp 1.420,– (19.09.2017), (3) GBp 1.392,– (19.10.2017), (4) GBp 1.331,– (20.11.2017), (5) GBp 1.311,– (19.12.2017), (6) GBp 1.291,– (19.01.2018), (7) GBp 1.213,– (20.02.2018), (8) GBp 1.219,50 (19.03.2018), (9) GBp 1.323,50 (19.04.2018), (10) GBp 1.427,50 (22.05.2018), (11) GBp 1.349,50

	(19.06.2018), (12) GBp 1.352,– (19.07.2018), (13) GBp 1.262,– (20.08.2018), **14) Transcanada Corp/CA87807B1076** (1) CAD 61,91 (21.08.2017), (2) CAD 62,51 (19.09.2017), (3) CAD 62,31 (19.10.2017), (4) CAD 63,51 (20.11.2017), (5) CAD 61,77 (19.12.2017), (6) CAD 59,82 (19.01.2018), (7) CAD 56,89 (20.02.2018), (8) CAD 54,79 (19.03.2018), (9) CAD 55,24 (19.04.2018), (10) CAD 55,09 (22.05.2018), (11) CAD 56,62 (19.06.2018), (12) CAD 59,41 (19.07.2018), (13) CAD 58,39 (20.08.2018), **15) Vinci S.A./FR0000125486** (1) EUR 76,14 (21.08.2017), (2) EUR 80,51 (19.09.2017), (3) EUR 80,90 (19.10.2017), (4) EUR 85,35 (20.11.2017), (5) EUR 87,21 (19.12.2017), (6) EUR 87,76 (19.01.2018), (7) EUR 82,78 (20.02.2018), (8) EUR 80,64 (19.03.2018), (9) EUR 83,74 (19.04.2018), (10) EUR 87,26 (22.05.2018), (11) EUR 84,50 (19.06.2018), (12) EUR 84,58 (19.07.2018), (13) EUR 82,– (20.08.2018),
Referenzpreis an den Beobachtungstagen zum Laufzeitende	**1) American Electric Power Company, Inc./US0255371017** (1) USD 82,91 (11.04.2024) **2) Basket: 1 x Siemens AG (DE0007236101) + 0,5 x Siemens Energy (DE000ENER6Y0)/SIEGn_ENR1n** (1) EUR 182,29 (11.04.2024) **3) Basket: 1,014131338 x HOLN.S/HOLN.S_ex_PA** (1) CHF 79,852702 (11.04.2024) **4) Enagás S.A./ES0130960018** (1) EUR 13,60 (11.04.2024) **5) ENI S.p.A./IT0003132476** (1) EUR 15,318 (11.04.2024) **6) Geberit AG/CH0030170408** (1) CHF 510,40 (11.04.2024) **7) Iberdrola S.A./ES0144580Y14** (1) EUR 11,125 (11.04.2024) **8) Pembina Pipeline Corp/CA7063271034** (1) CAD 48,01 (11.04.2024) **9) PPL Corp/US69351T1060** (1) USD 26,74 (11.04.2024) **10) Skanska AB Class B/SE0000113250** (1) SEK 191,45 (11.04.2024) **11) Snam S.p.A/IT0003153415** (1) EUR 4,197 (11.04.2024) **12) Southern Company/US8425871071** (1) USD 69,58 (11.04.2024) **13) SSE PLC/GB0007908733** (1) GBp 1.608,50 (11.04.2024) **14) Transcanada Corp/CA87807B1076** (1) CAD 50,27 (11.04.2024) **15) Vinci S.A./FR0000125486** (1) EUR 112,75 (11.04.2024)
Nennbetrag (kleinste handelbare Einheit)	EUR 1.000,–
Teilhabefaktor	100 %
Physische Lieferung möglich	nein

AKTUELLE RÜCKZAHLUNG

Wertentwicklung (Durchschnittswert der Referenzpreise an den Beobachtungstagen im Vergleich zum Referenzpreis am anfänglichen Bewertungstag)	20,3028 %
Aktuelle Rückzahlung am Rückzahlungstermin	EUR 1.203,03

ANFÄNGLICHER BEWERTUNGSTAG

Anfängliche Feststellung	20. August 2018
Referenzpreis am anfänglichen Bewertungstag	1) USD 70,358462 2) EUR 114,605385 3) CHF 46,656154 4) EUR 23,492692 5) EUR 14,649231 6) CHF 439,484615 7) EUR 6,516154 8) CAD 43,26 9) USD 31,954615 10) SEK 169,688462 11) EUR 3,897231 12) USD 47,074615 13) GBp 1.332,538462 14) CAD 59,096923 15) EUR 83,336154

1. KAPITALMAßNAHME

Art der Kapitalmaßnahme	Änderung des Bloomberg Tickers von GEBN VX Equity auf GEBN SW Equity
Datum	23. Oktober 2017
Basiswert (Bezugswert, welcher der Anleihe zugrunde liegt)/ISIN	Geberit AG/CH0030170408
Anpassungsfaktor (r)	1

2. KAPITALMAßNAHME

Art der Kapitalmaßnahme	Abspaltung der Siemens Energy AG. Basket building: 1 x Siemens AG (DE0007236101) + 0,5 x Siemens Energy (DE000ENER6Y0)
Datum	28. September 2020
Basiswert (Bezugswert, welcher der Anleihe zugrunde liegt)/ISIN	Basket: 1 x Siemens AG (DE0007236101) + 0,5 x Siemens Energy (DE000ENER6Y0)
Anpassungsfaktor (r)	1

3. KAPITALMAßNAHME

Art der Kapitalmaßnahme	Änderung Börsenlisting von New York Stock Exchange (Codes AEP.N/AEP UN Equity/XNYS) zu The Nasdaq Global Select Market (AEP.OQ/AEP UW Equity/XNGS)
Datum	1. Oktober 2020
Basiswert (Bezugswert, welcher der Anleihe zugrunde liegt)/ISIN	American Electric Power Company, Inc./US0255371017
Anpassungsfaktor (r)	1

4. KAPITALMAßNAHME

Art der Kapitalmaßnahme	Sonderdividende über 3.00 SEK
Datum	31. März 2021
Basiswert (Bezugswert, welcher der Anleihe zugrunde liegt)/ISIN	Skanska AB Class B/SE0000113250
Anpassungsfaktor (r)	0,9865782

	Wert vor Kapitalmaßnahme	Wert nach Kapitalmaßnahme
Referenzpreis am anfänglichen Bewertungstag	SEK 169,688462	SEK 167,410937

5. KAPITALMAßNAHME

Art der Kapitalmaßnahme	Änderung Name/Reuters/BBG von "LafargeHolcim Ltd"/LHN.PA/LHN FP Equity in "Holcim Ltd"/HOLN.PA/HOLN FP Equity
Datum	10. Mai 2021
Basiswert (Bezugswert, welcher der Anleihe zugrunde liegt)/ISIN	Basket: 1,014131338 x HOLN.S
Anpassungsfaktor (r)	1

6. KAPITALMAßNAHME

Art der Kapitalmaßnahme	Sonderdividende	
Datum	30. März 2022	
Basiswert (Bezugswert, welcher der Anleihe zugrunde liegt)/ISIN	Skanska AB Class B/SE0000113250	
Anpassungsfaktor (r)	0,9863507	
	Wert vor Kapitalmaßnahme	Wert nach Kapitalmaßnahme
Referenzpreis am anfänglichen Bewertungstag	SEK 167,410937	SEK 165,125895

7. KAPITALMAßNAHME

Art der Kapitalmaßnahme	Änderung Börsenlisting von Euronext Paris (Codes HOLN.PA/HOLN FP Equity/XPAR) zu SIX Swiss Exchange (HOLN.S/HOLN SE Equity/XSWX): Basketbildung (Basket: 1,014131338 x HOLN.S)
Datum	30. Dezember 2022
Basiswert (Bezugswert, welcher der Anleihe zugrunde liegt)/ISIN	Holcim Ltd/CH0012214059
Anpassungsfaktor (r)	1

NOCH FRAGEN ?

Unser Experten-Team steht Ihnen gerne zur Verfügung:	Weitere Informationen erhalten Sie auch unter:
InfoLine: +49 89 378-17466	www.onemarkets.de
E-Mail: onemarkets@unicredit.de	

Die hierin enthaltenen Bewertungen sind von rein indikativer Natur und werden nur zum Zweck der Information generiert. Sie basieren auf Daten, die als zuverlässig gelten. Es wird keine Zusicherung oder Garantie hinsichtlich der Richtigkeit oder Vollständigkeit solcher Bewertungen und der Quellen, auf denen sie beruhen, gegeben. Alle hier zum Ausdruck gebrachten Annahmen, Meinungen und Schätzungen stellen unsere Beurteilung zu diesem Zeitpunkt dar und können sich jederzeit ohne vorherige Ankündigung ändern. Diese Bewertungen können wesentlich von einklagbaren Werten abweichen, insbesondere in volatilen Marktbedingungen. Wir garantieren nicht, dass eine Transaktion mit solchen Bewertungen ausgeführt werden kann bzw. könnte oder dass diese Werte in irgendeiner Form Hinweise auf die künftige Entwicklung geben. Die Bewertungen enthalten keine Anpassungen für Transaktions- und Absicherungskosten, buchhalterische Aufrechnungen und Rückstellungen, Liquiditäts- oder Kreditberücksichtigungen oder andere wesentliche Faktoren, die nicht Teil unserer eigenen Bewertungsmodelle und/oder Preise oder jener unserer Tochtergesellschaften sind und die zu einer erheblichen Abweichung der tatsächlichen Werte führen können. Wir sind nicht verpflichtet, Sie jetzt oder in Zukunft über Änderungen dieser Daten zu informieren. Wir übernehmen keine Verantwortung für die Nutzung der oder den Verlass auf die hierin enthaltenen Informationen. Wir übernehmen insbesondere keine Haftung für Ihnen oder einer dritten Partei entstandene Verluste, Ansprüche oder Schäden, die direkt oder indirekt aus der Nutzung der oder den Verlass auf die hierin enthaltenen Informationen entstehen. Dies gilt ohne Einschränkung. Wir haben möglicherweise eine bestehende Position in hierin genannten Instrumenten oder Währungen und bieten den Emittenten möglicherweise auch Bank- oder andere Beratungsdienstleistungen an.

Die angegebenen Bewertungen können auf einer Reihe von Faktoren basieren, darunter insbesondere aktuelle Kurse, die Bewertung der Basiswerte, die Marktliquidität, Informationen aus unseren eigenen Modellen und Annahmen sowie aus jenen unserer Tochtergesellschaften sowie Informationen aus öffentlichen Quellen. Durch die Bereitstellung dieser Informationen geben wir nicht die Zusicherung, dass diese durch tatsächliche Handelsgeschäfte bestätigt wurden oder dass ein Markt für die relevanten Instrumente existiert. Aus diesem Grund kann der oben genannte geschätzte Marktwert sich erheblich von dem Wert unterscheiden, den wir angeben oder angeben würden, wenn und soweit solche Instrumente in unserem aktuellen oder künftigen Bestand wären. Bewertungen, die auf anderen Modellen oder Annahmen basieren oder zu einem anderem Datum und Zeitpunkt oder für eine andere Menge berechnet werden, können zu deutlich abweichenden Werten führen.

Die Bewertungen dürfen nicht als eine Form der Aufforderung zum Kauf oder Verkauf eines Instruments oder zur Verfolgung einer Handelsstrategie verstanden werden. Sie sind nicht für die Verbreitung in Rechtsordnungen vorgesehen, in denen eine solche Verbreitung gesetzlich oder aufgrund von Verordnungen eingeschränkt ist, und Empfänger, die in den Besitz dieses Dokuments gelangen, sollten sich über solche Einschränkungen informieren und diese beachten. Diese Informationen sind vertraulich und dürfen unter keinen Umständen ohne ausdrückliche schriftliche Genehmigung weder ganz noch teilweise weitergegeben oder vervielfältigt werden.

UniCredit Bank GmbH London Branch ist in England und Wales als ausländische Gesellschaft (FC009673) und als Niederlassung (BR001757) eingetragen. Zugelassen und reguliert durch die Financial Conduct Authority im Vereinigten Königreich. UniCredit Bank GmbH London Branch ist eine Geschäftsstelle der UniCredit Bank GmbH, die Mitglied der UniCredit Group ist. Die UniCredit Bank GmbH hat ihren Hauptsitz in der Kardinal-Faulhaber-Straße 1, 80333 München, Deutschland und ist unter der Handelsregisternummer HRB42148 eingetragen. Sie wird von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) beaufsichtigt.