UC European Overnight Capitalisation Index

in der Fassung vom 22. November 2026

1. Allgemeine Beschreibung

Der UC European Overnight Capitalisation Index (der „Index") soll die Performance einer kontinuierlichen Investition in eine täglich prolongierte Tagesgeldanlage wiedergeben. Referenzzinssatz ist der jeweils gültige €STR-Zinssatz (Euro Short-Term Rate) zzgl. 0,085%, der für jeden Tag, an dem das Real Time Gross Settlement System des Eurosystems (oder ein Nachfolgesystem) (T2) geöffnet ist (je ein „T2-Handelstag"), von der Europäischen Zentralbank („EZB", der „Administrator") oder einem Nachfolge-Administrator berechnet und am folgenden T2-Handelstag veröffentlicht wird. Der Index wird von der Indexberechnungsstelle (Abschnitt 4) in Euro und aufgrund des jeweils gültigen, von der EZB festgestellten €STR-Zinssatzes berechnet. Der Index ist über den Finanzinformationsdienst Bloomberg (UCGREONC Index) abrufbar.

Der Index startete am 12. April 2006 mit einem Wert von 100.

2. Berechnung des Index

Der Wert des Index ist zu jedem Zeitpunkt definiert als

$$\text{Index}(t) = \text{Index}(t\text{-}1) \times \left[1 + \left(\frac{(€\text{STR}_{t-1} + 0{,}085\%) \times \text{Tage}_{t\text{-}1;t}}{360}\right)\right]$$

wobei

Index(t)	ist der von der Indexberechnungsstelle festgestellte Wert des Index am T2-Handelstag t.
Index(t-1)	ist der von der Indexberechnungsstelle festgestellte Wert des Index am T2-Handelstag t-1 (vor Rundung).
$€\text{STR}_{t\text{-}1}$	ist gleich dem €STR-Zinssatz vom T2-Handelstag t-1.
$\text{Tage}_{t\text{-}1,t}$	ist gleich der Anzahl der Kalendertage zwischen den T2-Handelstagen t und t-1.

Der zu veröffentlichende Indexwert wird ab dem 15. Dezember 2021 auf die dritte Nachkommastelle auf- oder abgerundet, wobei 0,0005 aufgerundet wird.

3. Berechnung des Index im Falle einer Marktstörung

Eine "Marktstörung" liegt im Falle eines der folgenden Ereignisse vor:

(1) ein Tag, für den trotz geöffnetem T2-System kein €STR-Zinssatz vom Administrator ermittelt und veröffentlicht wird.

(2) die Erklärung eines allgemeinen Moratoriums für Bankgeschäfte in der europäischen Währungsunion auf Grund staatlicher Verordnung.

Im Falle einer Marktstörung behält sich die Indexberechnungsstelle vor, den Index für die Dauer der Marktstörung mit dem letzten verfügbaren €STR-Zinssatz fortzuführen.

4. Indexsponsor und Indexberechnungsstelle

Der Index wird von der UniCredit S.p.A.[1] oder jedem Rechtsnachfolger (der "Indexsponsor") bereitgestellt. Der Indexsponsor übernimmt in diesem Zusammenhang alle Rechte und Pflichten aus dieser Indexbeschreibung, sofern diese nicht anderweitig übertragen wurden.

Der Indexsponsor hat alle die Berechnung des Index betreffenden Rechte und Pflichten an die Indexberechnungsstelle übertragen. Indexberechnungsstelle ist die UniCredit S.p.A.[1] oder jeder Rechtsnachfolger (die "*Indexberechnungsstelle*"). Der Indexsponsor ist jederzeit berechtigt, eine neue Indexberechnungsstelle zu benennen (die "*Neue Indexberechnungsstelle*"). Ab einem solchen Zeitpunkt beziehen sich alle Bezugnahmen auf die Indexberechnungsstelle in dieser Indexbeschreibung je nach Kontext auf die Neue Indexberechnungsstelle.

Die Indexberechnungsstelle wird, vorbehaltlich nachstehender Regelungen, die oben genannte Berechnungsmethode anwenden, und die so gewonnenen Ergebnisse sind, sofern keine offensichtlichen Fehler vorliegen, endgültig. Für den Fall, dass regulatorische, rechtliche oder steuerliche Umstände (einschließlich eines Verwaltungsakts einer zuständigen Aufsichtsbehörde) eintreten, die eine Modifikation oder Änderung dieser Methode erforderlich machen, hat der Indexsponsor das Recht, auf Grundlage der vorstehend genannten Regelungen die erforderlichen Modifikationen oder Änderungen nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) vorzunehmen. Die Indexberechnungsstelle wird mit der größtmöglichen Sorgfalt sicherstellen, dass die sich daraus ergebende Methode mit der oben definierten Methode konsistent sein wird und die wirtschaftliche Situation der Inhaber von auf den Index bezogenen Finanzprodukten berücksichtigen.

Bei der Berechnung des Index muss sich die Indexberechnungsstelle auf Aussagen, Bestätigungen, Berechnungen, Zusicherungen und andere Informationen, die von Dritten zur Verfügung gestellt werden und nicht überprüft werden können, verlassen. Jegliche in diesen Informationen enthaltene Fehler können sich ohne Verschulden der Indexberechnungsstelle auf die Berechnung des Index auswirken. Es besteht keine Verpflichtung der Indexberechnungsstelle, die in Bezug auf den Index bezogenen Informationen unabhängig zu überprüfen.

5. Eingabedaten

Die Indexberechnungsstelle ist berechtigt, Eingabedaten zur Berechnung des Index (z.B. den €STR-Zinssatz) (die "*Eingabedaten*") über die Informationsdienstleister Bloomberg oder Reuters (die "*Informationsdienstleister*") oder eine andere repräsentative öffentlich verfügbare Datenquelle zu beziehen.

6. Haftungsausschluss

Die Berechnung des Index wird durch die Indexberechnungsstelle mit der erforderlichen Sorgfalt durchgeführt. Weder der Indexsponsor noch die Indexberechnungsstelle haften jedoch für direkte oder indirekte Schäden, die aus einfacher Fahrlässigkeit des Indexsponsors oder der Indexberechnungsstelle im Zusammenhang mit der Berechnung oder Zusammenstellung des Index oder ihrer jeweiligen Parameter resultieren.

Die Berechnung des Indexwerts wird durch die Indexberechnungsstelle mit der erforderlichen Sorgfalt

[1] Mit Wirkung zum 22. November 2026 hat die UniCredit Bank GmbH ihre Funktion als Indexsponsor und Indexberechnungsstelle einschließlich aller damit verbundenen Rechte und Pflichten auf die UniCredit S.p.A. übertragen.

durchgeführt. Jede Haftung des Indexsponsors und der Indexberechnungsstelle ist ausgeschlossen, außer im Fall von Vorsatz oder grober Fahrlässigkeit. Weder der Indexsponsor noch die Indexberechnungsstelle können jedoch die Richtigkeit der der Berechnung zugrundeliegenden Marktdaten oder sonstigen Informationen Dritter garantieren. Weder der Indexsponsor noch die Indexberechnungsstelle haften für direkte oder indirekte Schäden, die aus der Fehlerhaftigkeit von der Berechnung des Indexwerts zugrundeliegenden Marktdaten oder sonstigen Informationen Dritter resultieren.

Weder der Indexsponsor noch eine andere im Zusammenhang mit dem Index tätige Person üben die Funktion eines Treuhänders oder Beraters gegenüber den Inhabern von auf den Index bezogenen Finanzprodukten aus.

7. Veröffentlichung

Der Indexwert wird von der Indexberechnungsstelle auf der Internetseite www.onemarkets.eu (oder einer Nachfolgeseite) veröffentlicht. Zudem kann der Indexwert auf Bloomberg unter dem Ticker UCGREONC <Index> (oder einer Nachfolgeseite) abgerufen werden.

8. Unwirksame Bestimmungen

Sollten eine oder mehrere Bestimmungen dieser Indexbeschreibung ganz oder teilweise unwirksam sein oder sich als undurchführbar erweisen, so wird die Wirksamkeit der anderen Bestimmungen im Übrigen hiervon nicht berührt.

9. Anwendbares Recht

Diese Indexbeschreibung unterliegt deutschem Recht.