

OBJECT: ADJUSTMENTS ON EDF SA UNDERLYING
GENERAL INFORMATION ABOUT THE CORPORATE ACTION

DESCRIPTION	Aumento a pagamento del capitale sociale su EDF SA, mediante offerta in opzione agli azionisti di azioni ordinarie EDF in ragione di n. 2 nuove azioni ogni n. 13 azioni possedute al prezzo di sottoscrizione di Euro 6.35 per ciascuna nuova azione – Ex date 21/03/2022 (come da Avviso Eurex del 18 Marzo 2022)
Underlying ISIN Code	FR0010242511
Underlying Name	EDF SA
EFFECTIVE DATE	21/03/2022

DETAILS ABOUT THE ADJUSTMENT

ADJUSTMENT CRITERIA	Applicazione a Strike e Multipli del sottostante EDF del Fattore di Aggiustamento K, calcolato secondo quanto indicato nell'Avviso Eurex del 18 Marzo 2022
DERIVATIVE MARKET	Euronext

ADJUSTMENT FACTOR

0.95611

FEATURES OF ADJUSTED FINANCIAL INSTRUMENTS

ADJUSTMENT EFFECTIVE DATE 21/03/2022

INVESTMENT CERTIFICATES SINGLE SHARE

Cod Isin	Underlying	Parity Old	Parity	Strike Old	Strike	First Barrier Old	First Barrier	Initial Value Old	Initial Value	Second Barrier Old	Second Barrier
IT0005429474	EDF SA	7.818608	8.17752	12.79	12.2286	8.953	8.5601	12.79	12.2286		
IT0005429482	EDF SA	7.818608	8.17752	12.79	12.2286	7.674	7.3372	12.79	12.2286		
IT0005433492	EDF SA	8.032129	8.40084	12.45	11.9036	9.3375	8.9277	12.45	11.9036	9.3375	8.9277
IT0005436404	EDF SA	9.727626	10.17417	10.28	9.8288	7.196	6.8802	10.28	9.8288	7.196	6.8802
IT0005439341	EDF SA	9.01713	9.43106	11.09	10.6033	8.3175	7.9524	11.09	10.6033		
IT0005440588	EDF SA	8.857396	9.26399	11.29	10.7945	6.774	6.4767	11.29	10.7945		

Cod Isin	Underlying	Parity Old	Parity	Strike Old	Strike	First Barrier Old	First Barrier	Initial Value Old	Initial Value	Second Barrier Old	Second Barrier
IT0005441354	EDF SA	8.173273	8.54847	12.235	11.698	8.5645	8.1886	12.235	11.698	8.5645	8.1886
IT0005443210	EDF SA	8.159935	8.53451	12.255	11.7171	8.5785	8.202	12.255	11.7171	8.5785	8.202
IT0005445645	EDF SA	8.602151	8.99703	11.625	11.1148	7.5563	7.2247	11.625	11.1148	7.5563	7.2247
IT0005445652	EDF SA	8.602151	8.99703	11.625	11.1148	8.7188	8.3361	11.625	11.1148	8.7188	8.3361
IT0005449605	EDF SA	8.35771	8.74137	11.965	11.4399	8.3755	8.0079	11.965	11.4399	8.3755	8.0079
IT0005451536	EDF SA	8.521517	8.9127	11.735	11.22	8.8013	8.415	11.735	11.22	8.8013	8.415
IT0005459414	EDF SA	8.956561	9.36771	11.165	10.675	8.3738	8.0063	11.165	10.675		
IT0005459653	EDF SA	8.956561	9.36771	11.165	10.675	8.3738	8.0063	11.165	10.675		
IT0005465718	EDF SA	7.633588	7.98401	13.1	12.525	9.825	9.3938	13.1	12.525	9.825	9.3938
IT0005467987	EDF SA	7.93336	8.29754	12.605	12.0518	9.4538	9.0389	12.605	12.0518	9.4538	9.0389
IT0005469496	EDF SA	8.071025	8.44152	12.39	11.8462	9.2925	8.8847	12.39	11.8462	9.2925	8.8847
IT0005483216	EDF SA	12.53133	13.10658	7.98	7.6298	5.586	5.3408	7.98	7.6298	5.586	5.3408
IT0005487464	EDF SA	12.10361	12.65922	8.262	7.8994	4.9572	4.7396	8.262	7.8994	4.9572	4.7396

INVESTMENT CERTIFICATES BASKET

Cod Isin	Underlying	Strike Info Old	Strike Info
XS2109190152	EDF SA	12.9708	12.4015
XS2249459814	EDF SA	12.8133	12.2509