BNP PARIBAS

La banque d'un monde qui change

Avis aux porteurs des titres dont le sous-jacent est l'action ordinaire thyssenkrupp AG
(Code ISIN : DE0007500001)

Date : 27 octobre 2026
Nature de l'opération : Spin-off (Scission) et Re-désignation de sous-jacents
Chers clients,
Nous vous informons qu'une opération sur le sous-jacent **thyssenkrupp AG** entraînera un ajustement technique de certains produits dérivés détenus via la méthode du « Basket » (panier d'actifs). Cet ajustement fait suite à une opération de scission (spin-off) de la société **tk accelis Group**.

1. Détails de l'opération sur le sous-jacent

- **Type d'événement :** Spin-off (Scission)
- **Date d'effet :** 28 octobre 2026
- **Date de détachement (Record Date) :** 29 octobre 2026
- **Nouvelle composante :** tk accelis Group (ISIN : DE000TKCC1S8)

2. Impact sur les produits dérivés (Ajustements)
En raison de cet événement, les sous-jacents de vos produits dérivés ne seront plus constitués d'une action unique, mais d'un panier d'actions (Basket). Les prix de référence seront désormais calculés sur la base de la valeur combinée des composants du panier.
A. Pour le nouveau panier (New Basket) : DE000A4AYEL9
Le sous-jacent est remplacé par un panier composé de :

- **1 action** thyssenkrupp AG (DE0007500001)
- **0,05 action** tk accelis Group (DE000TKCC1S8)

Livraison physique : Lors de l'exercice d'une option sur ce panier, pour un contrat, un panier contenant **100 actions thyssenkrupp AG** et **5 actions tk accelis Group** sera livré contre le paiement de l'équivalent de (Taille du contrat [100] x Prix d'exercice).
B. Pour le panier mis à jour (Updated Basket) : DE000A4APUH1
À la clôture du 27 octobre 2026, la composition de ce panier sera modifiée pour inclure la nouvelle entité.

- **Avant l'ajustement :** 1 action thyssenkrupp AG + 0,05 action TKMS AG & Co. KGaA.
- **Après l'ajustement :** 1 action thyssenkrupp AG + 0,05 action TKMS AG & Co. KGaA + **0,05 action tk accelis Group**.

Livraison physique : Lors de l'exercice, pour un contrat, un panier contenant **100 actions thyssenkrupp AG**, **5 actions TKMS** et **5 actions tk accelis Group** sera livré contre le paiement de l'équivalent de (Taille du contrat [100] x Prix d'exercice).

Classification : Internal

3. Éléments inchangés

Sauf mention contraire, les paramètres suivants restent **invariés** :

- Prix d'exercice (Strike Price)
- Taille du contrat (Contract Size / Lot Size)

4. Informations administratives

- **Changement de mnémonique :** Veuillez noter qu'un changement de mnémonique (MNEMO) sera appliqué sur les options cotées.
- **Nouvel ISIN :** Les produits concernés adopteront un nouvel ISIN correspondant à leur nouveau sous-jacent "Basket".

Nous vous recommandons de consulter vos relevés de compte pour identifier précisément les titres impactés par ces changements.

BNP Paribas Arbitrage S.N.C. 1 rue Laffitte 75009 Paris, France
L'agent de calcul

Classification : Internal