

NACHTRAG NR. 1 VOM 8. MÄRZ 2024
GEMÄß ARTIKEL 23 (1) DER VERORDNUNG (EU)
2017/1129 (IN DER JEWELS GÜLTIGEN FASSUNG)
(DIE "PROSPEKTVERORDNUNG")
ZUM BASISPROSPEKT VOM 28. SEPTEMBER 2023

J.P.Morgan

J.P. Morgan Structured Products B.V.

(errichtet in den Niederlanden mit beschränkter Haftung)

als Emittentin

und

J.P. Morgan SE

(errichtet als Europäische Aktiengesellschaft in Deutschland)

als Garantin in Bezug auf die Wertpapiere

Programm für die Emission

von

Anleihen, Optionsscheinen und Zertifikaten

Arrangeur für das Programm

J.P. Morgan SE

Anbieter ("Dealer") für das Programm

J.P. Morgan SE

Der maßgebliche neue Umstand, aufgrund dessen dieser Nachtrag (der "Nachtrag") zu dem Basisprospekt vom 28. September 2023 im Zusammenhang mit der Begebung von Nichtdividendenwerten unter dem Programm für die Emission von Anleihen, Optionsscheinen und Zertifikaten durch J.P. Morgan Structured Products B.V. und garantiert durch J.P. Morgan SE (der "Basisprospekt") erstellt wurde, ist die Entscheidung vom 28. Februar 2024, die Risikofaktoren bezüglich der JPMorgan Chase zu aktualisieren, wie sie im Registrierungsformular der J.P. Morgan Structured Products B.V. vom 19. April 2023 (das "JPMSP Registrierungsformular") enthalten sind und die auch im Registrierungsformular der J.P. Morgan SE vom 2. Juni 2023 (das "JPMSE Registrierungsformular") enthalten sind. Im Zusammenhang mit der Entscheidung, die Risikofaktoren bezüglich der JPMorgan Chase zu aktualisieren, haben (i) die J.P. Morgan Structured Products B.V. das JPMSP Registrierungsformular durch den Nachtrag Nr. 3 vom 28. Februar 2024 zum JPMSP Registrierungsformular, der von der Commission de Surveillance du Secteur Financier in Luxembourg ("CSSF") am 28. Februar 2024 gebilligt wurde, und die (ii) J.P. Morgan SE das JPMSE Registrierungsformular durch den Nachtrag Nr. 2 vom 6. März 2024 zum JPMSE Registrierungsformular, der von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (die "BaFin") am 7. März 2024 gebilligt wurde, nachgetragen. Die Informationen in dem Nachtrag Nr. 3 zum JPMSP Registrierungsformular und die Informationen in dem Nachtrag Nr. 2 zum JPMSE Registrierungsformular werden mittels dieses Nachtrags in den Basisprospekt einbezogen.

I. Anpassungen zum Abschnitt "II. RISIKOFAKTOREN"

- 1) *Die Informationen in dem Unterabschnitt "A. Risiken im Zusammenhang mit der Emittentin" auf der Seite 15 des Basisprospekts werden wie folgt ersetzt:*

"Die auf den Seiten 4 bis 38 des von der Commission de Surveillance du Secteur Financier in Luxembourg ("CSSF") gebilligten dritten Nachtrags vom 28. Februar 2024 zum JPMSP Registrierungsformular enthaltenen Risikofaktoren werden hiermit per Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen (eine genaue Angabe der Seiten im dritten Nachtrag vom 28. Februar 2024 zum JPMSP Registrierungsformular von denen Informationen einbezogen werden, findet sich im Abschnitt "XIV. Allgemeine Informationen" unter "4. Durch Verweis einbezogene Informationen")."

- 2) *Die Informationen in dem Unterabschnitt "B. Risiken im Zusammenhang mit der Garantin" auf der Seite 15 des Basisprospekts werden wie folgt ersetzt:*

"Die auf den Seiten 3 bis 13 des von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht gebilligten JPMSE Registrierungsformulars vom 2. Juni 2023 (wie zuletzt nachgetragen durch den zweiten Nachtrag vom 6. März 2024 zum JPMSE Registrierungsformular) enthaltenen Risikofaktoren sowie die auf den Seiten 4 bis 38 des von der CSSF gebilligten dritten Nachtrags vom 28. Februar 2023 zum JPMSP Registrierungsformular enthaltenen Risikofaktoren werden hiermit per Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen (eine genaue Angabe der Seiten im JPMSE Registrierungsformular, im zweiten Nachtrag vom 6. März 2024 zum JPMSE Registrierungsformular und im dritten Nachtrag vom 28. Februar 2024 zum JPMSP Registrierungsformular, von denen Informationen einbezogen werden, findet sich im Abschnitt "XIV. Allgemeine Informationen" unter "4. Durch Verweis einbezogene Informationen")."

II. Anpassungen zum Abschnitt "XII. WESENTLICHE ANGABEN ZUR EMITTENTIN"

Die Informationen in diesem Abschnitt auf der Seite 315 des Basisprospekts werden wie folgt ersetzt:

"Hinsichtlich der erforderlichen Angaben über die J.P. Morgan Structured Products B.V. als Emittentin der Wertpapiere werden gemäß Artikel 19 Absatz 1 der Prospektverordnung die in dem von der CSSF gebilligten

englischsprachigen Registrierungsformular der J.P. Morgan Structured Products B.V. vom 19. April 2023 (das "**JPMSP Registrierungsformular**"), dem ersten Nachtrag vom 12. Juli 2023 zum JPMSP Registrierungsformular (der "**Erste Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular**"), dem zweiten Nachtrag vom 20. September 2023 zum JPMSP Registrierungsformular (der "**Zweite Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular**") und dem dritten Nachtrag vom 28. Februar 2024 zum JPMSP Registrierungsformular (der "**Dritte Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular**") sowie die ungeprüften Zwischenfinanzinformationen der JPMSP für die sechs Monate endend am 30. Juni 2023 (die "**JPMSP Zwischenfinanzinformationen 2023**"), die in dem geprüften Jahresabschluss der JPMSP für das am 31. Dezember 2022 geendete Geschäftsjahr (der "**JPMSP Jahresabschluss 2022**") und dem geprüften Jahresabschluss der JPMSP für das am 31. Dezember 2021 geendete Geschäftsjahr (der "**JPMSP Jahresabschluss 2021**") enthaltenen Informationen per Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen (eine genaue Angabe der Seiten im JPMSP Registrierungsformular, dem Ersten Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular, dem Zweiten Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular, dem Dritten Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular, den JPMSP Zwischenfinanzinformationen 2023, dem JPMSP Jahresabschluss 2022 und dem JPMSP Jahresabschluss 2021, von denen Informationen per Verweis einbezogen werden, findet sich im Abschnitt "XIV. Allgemeine Informationen" unter "4. Durch Verweis einbezogene Informationen")."

III. Anpassungen zum Abschnitt "XIII. WESENTLICHE ANGABEN ZUR GARANTIN"

Die Informationen in diesem Abschnitt auf der Seite 316 des Basisprospekts werden wie folgt ersetzt:

"Hinsichtlich der erforderlichen Angaben über die J.P. Morgan SE als Garantin der Wertpapiere werden gemäß Artikel 19 Absatz 1 der Prospektverordnung die in dem von der Zuständigen Behörde gebilligten englischsprachigen Registrierungsformular der J.P. Morgan SE vom 2. Juni 2023 (das "**JPMSE Registrierungsformular**"), dem zweiten Nachtrag vom 6. März 2024 zum JPMSE Registrierungsformular (der "**Zweite Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular**") und dem Dritten Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular sowie in dem geprüften Jahresabschluss der JPMSE für das am 31. Dezember 2022 geendete Geschäftsjahr (der "**JPMSE Jahresabschluss 2022**") und dem geprüften Jahresabschluss der JPMSE für das am 31. Dezember 2021 geendete Geschäftsjahr (der "**JPMSE Jahresabschluss 2021**") enthaltenen Informationen per Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen (eine genaue Angabe der Seiten im JPMSE Registrierungsformular, dem Zweiten Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular, dem Dritten Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular, dem JPMSE Jahresabschluss 2022 und dem JPMSE Jahresabschluss 2021, von denen Informationen per Verweis einbezogen werden, findet sich im Abschnitt "XIV. Allgemeine Informationen" unter "4. Durch Verweis einbezogene Informationen")."

IV. Anpassungen zum Abschnitt "XIV. ALLGEMEINE INFORMATIONEN"

- 1) *In dem Unterabschnitt "2. Bereithaltung des Basisprospekts" auf den Seiten 317 f. des Basisprospekts wird die im dritten Absatz enthaltene Liste wie folgt ersetzt:*

- das JPMSP Registrierungsformular vom 19. April 2023 (unter <https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/jpmsp-registration-document-19-april-2023-final-version.pdf>),
- der Erste Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular (unter <https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/supplement-no.-1-to-the-2023-jpmsp-registration-document.pdf>),

- der Zweite Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular (unter <https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/supplement-no.-2-to-the-2023-jpmsp-registration-document.pdf>),
- der Dritte Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular (unter <https://jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/supplement-no.-3-to-the-19-april-2023-jpmsp-registration-document.pdf>) und etwaige künftige Nachträge zum JPMSP Registrierungsformular,
- der JPMSP Jahresabschluss 2022 (unter <https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/j.p.-morgan-structured-products-b.v.-unsigned-2022-annual-report---unsigned-auditors-report.pdf>),
- der JPMSP Jahresabschluss 2021 (unter <https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/j.p.-morgan-structured-products-b.v.---unsigned-2021-annual-report--unsigned-auditors-report---unst.pdf>),
- die JPMSP Zwischenfinanzinformationen 2023 (unter <https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/jpmsp-2023-interim-financial-statements.pdf>),
- das JPMSE Registrierungsformular vom 2. Juni 2023 (unter https://jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/230602_JPMSE_RD_2023_sv3.pdf),
- der Zweite Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular (unter https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/fp-fp/240306_jpmse_reform_supplement_no._2_sv2.pdf) und etwaige künftige Nachträge zum JPMSE Registrierungsformular,
- der JPMSE Jahresabschluss 2022 (unter <https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/2022-annual-report-english.pdf>),
- der JPMSE Jahresabschluss 2021 (unter <https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/2021-annual-report-english.pdf>),
- die Statuten der JPMSP,
- die Satzung der JPMSE,
- die Liste der Produkte, für die das Angebot erstmalig unter dem Basisprospekt vom 10. Juni 2020 bzw. dem Basisprospekt vom 8. Juni 2021 bzw. dem Basisprospekt vom 7. Juni 2022 bzw. dem Basisprospekt vom 5. Juni 2023 begonnen worden ist und für die das öffentliche Angebot fortgeführt werden soll (unter <https://jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/isinlistbpSept2023.pdf>),
- der (deutschsprachige) Basisprospekt der JPMSP als Emittentin und der JPMSE als Garantin betreffend das Programm für die Emission von Anleihen, Optionsscheinen und Zertifikaten vom 10. Juni 2020 (der "**Basisprospekt vom 10. Juni 2020**") (unter https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/200610_jpm_basisprospekt_5sv.pdf),
- der (deutschsprachige) Basisprospekt der JPMSP als Emittentin und der JPMSE als Garantin betreffend das Programm für die Emission von Anleihen, Optionsscheinen und Zertifikaten vom 8. Juni 2021 (der "**Basisprospekt vom 8. Juni 2021**") (unter https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/210608_jpm_basisprospekt_sv4.pdf),
- der (deutschsprachige) Basisprospekt der JPMSP als Emittentin und der JPMSE als Garantin betreffend das Programm für die Emission von Anleihen, Optionsscheinen und Zertifikaten vom 7. Juni 2022 (der "**Basisprospekt vom 7. Juni 2022**") (unter https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/220607_jpm_basisprospekt.pdf und

- der (deutschsprachige) Basisprospekt der JPMSP als Emittentin und der JPMSE als Garantin betreffend das Programm für die Emission von Anleihen, Optionsscheinen und Zertifikaten vom 5. Juni 2023 (der "**Basisprospekt vom 5. Juni 2023**") (unter https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/230605_jpm_basisprospekt_sv3.pdf)."

2) Unter "A. Dokumente" in dem Unterabschnitt "4. Durch Verweis einbezogene Informationen" auf den Seiten 318 f. des Basisprospekts wird die Liste wie folgt ersetzt:

- "- das JPMSP Registrierungsformular vom 19. April 2023, das von der CSSF gebilligt wurde,
- der Erste Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular,
- der Zweite Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular,
- der Dritte Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular,
- der JPMSP Jahresabschluss 2022,
- der JPMSP Jahresabschluss 2021,
- die JPMSP Zwischenfinanzinformationen 2023,
- das JPMSE Registrierungsformular vom 2. Juni 2023, welches von der Zuständigen Behörde gebilligt wurde,
- der Zweite Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular,
- der JPMSE Jahresabschluss 2022,
- der JPMSE Jahresabschluss 2021,
- die Liste der Produkte, für die das Angebot erstmalig unter dem Basisprospekt vom 10. Juni 2020 bzw. dem Basisprospekt vom 8. Juni 2021 bzw. dem Basisprospekt vom 7. Juni 2022 bzw. dem Basisprospekt vom 5. Juni 2023 begonnen worden ist und für die das öffentliche Angebot fortgeführt werden soll,
- der Basisprospekt vom 10. Juni 2020,
- der Basisprospekt vom 8. Juni 2021,
- der Basisprospekt vom 7. Juni 2022, und
- der Basisprospekt vom 5. Juni 2023."

3) Unter "B. Informationen" in dem Unterabschnitt "4. Durch Verweis einbezogene Informationen" auf den Seiten 319 ff. des Basisprospekts wird die Position "Risk Factors" unter "JPMSP Registrierungsformular vom 19. April 2023" gelöscht.

4) Unter "B. Informationen" in dem Unterabschnitt "4. Durch Verweis einbezogene Informationen" auf den Seiten 319 ff. des Basisprospekts werden die Punkte "Erster Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular" und "Erster Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular" durch die folgenden Punkte ersetzt:

"

<i>Erster Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular</i> Informationen enthalten im Erster Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular	Seite 2 bis 3	Abschnitt XII. / Seite 315
<i>Dritter Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular</i> Informationen enthalten im Dritten Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular	Seite 2 Seiten 4 bis 38	Abschnitt II.A. / Seite 15 Abschnitt XII. / Seite 315
<i>Zweiter Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular</i> Informationen enthalten im Zweiten Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular	Seiten 2 bis 5	Abschnitt II.B. / Seite 15 "

Der Nachtrag, der Basisprospekt sowie etwaige weitere Nachträge werden auf der Internetseite <https://www.jpmorgan-zertifikate.de> unter der Rubrik "Dokumente" veröffentlicht.

Nach Artikel 23 Absatz 2 Prospektverordnung haben Anleger, die den Erwerb oder die Zeichnung der Wertpapiere bereits vor Veröffentlichung des Nachtrags zugesagt haben, das Recht, ihre Zusage innerhalb von drei Arbeitstagen nach der Veröffentlichung dieses Nachtrags zurückzuziehen, sofern die Wertpapiere den Anlegern zu dem Zeitpunkt, zu dem der wichtige neue Umstand, die wesentliche Unrichtigkeit oder die wesentliche Ungenauigkeit eingetreten ist oder festgestellt wurde, noch nicht geliefert worden waren.

Das Widerrufsrecht bezieht sich nur auf Wertpapiere, die unter dem Basisprospekt der J.P. Morgan Structured Products B.V. vom 28. September 2023 angeboten werden und auf die sich auch der Nachtrag bezieht.

Sofern die auf den Erwerb oder die Zeichnung der Wertpapiere gerichtete Willenserklärung gegenüber der Emittentin abgegeben worden ist, ist der Empfänger des Widerrufs die BNP Paribas S.A., Zweigniederlassung Deutschland, Senckenbergenanlage 19, 60325 Frankfurt am Main, Deutschland. Sofern die auf den Erwerb oder die Zeichnung der Wertpapiere gerichtete Willenserklärung gegenüber einem anderen als der Emittentin (der "Dritte") abgegeben worden ist, ist der Widerruf an diesen Dritten zu richten.