

NACHTRAG NR. 2 VOM 22. APRIL 2024
GEMÄß ARTIKEL 23 (1) DER VERORDNUNG (EU)
2017/1129 (IN DER JEWEILS 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

Die maßgeblichen neuen Umstände, aufgrund derer 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, sind (i) die Veröffentlichung des Registrierungsformulars der J.P. Morgan Structured Products B.V. vom 17. April 2024 (das "**JPMSP Registrierungsformular**"), das von der Commission de Surveillance du Secteur Financier in Luxembourg ("**CSSF**") gebilligt wurde, am 17. April 2024 und (ii) die Veröffentlichung des Nachtrags Nr. 3 vom 18. April 2024 zum Registrierungsformular der J.P. Morgan SE vom 2. Juni 2023 (das "**JPMSE Registrierungsformular**"), der von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (die "**BaFin**") gebilligt wurde. Die Informationen in dem JPMSP Registrierungsformular, die Informationen in dem JPMSP Jahresabschluss 2023 und die Informationen in dem Nachtrag Nr. 3 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 Risikofaktoren auf den Seiten 5 bis 41 des Registrierungsformulars der J.P. Morgan Structured Products B.V. vom 17. April 2024 (das "**JPMSP Registrierungsformular**"), das von der Commission de Surveillance du Secteur Financier in Luxembourg ("**CSSF**") gebilligt wurde, werden hiermit per Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen (eine genaue Angabe der Seiten im 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 nachgetragenen durch den dritten Nachtrag vom 18. April 2024 zum JPMSE Registrierungsformular) enthaltenen Risikofaktoren sowie die auf den Seiten 5 bis 41 des von der CSSF gebilligten JPMSP Registrierungsformulars enthaltenen Risikofaktoren werden hiermit per Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen (eine genaue Angabe der Seiten im JPMSE Registrierungsformular, im dritten Nachtrag vom 18. April 2024 zum JPMSE Registrierungsformular und im 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 17. April 2024 (das "**JPMSP Registrierungsformular**"), sowie die in dem geprüften Jahresabschluss der JPMSP für das am 31. Dezember 2023 geendete Geschäftsjahr (der "**JPMSP Jahresabschluss 2023**") und dem geprüften Jahresabschluss der JPMSP für das am 31. Dezember 2022 geendete Geschäftsjahr (der "**JPMSP Jahresabschluss 2022**") enthaltenen Informationen per Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen (eine

genaue Angabe der Seiten im JPMSP Registrierungsformular, dem JPMSP Jahresabschluss 2023 und dem JPMSP Jahresabschluss 2022, 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 dritten Nachtrag vom 18. April 2024 zum JPMSE Registrierungsformular (der "**Dritte Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular**") und dem 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 Dritten Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular, dem 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 17. April 2024 (unter <https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/fp-fp/jpm-sp-registration-document-17-april-2024---final-version.pdf>) und etwaige künftige Nachträge dazu,
- der JPMSP Jahresabschluss 2023 (unter <https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/fp-fp/jpm-sp-2023-annual-report.pdf>),
- 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>),
- das JPMSE Registrierungsformular vom 2. Juni 2023 (unter https://jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/230602_JPMSE_RD_2023_sv3.pdf) und etwaige künftige Nachträge dazu,
- der Dritte Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular (unter https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/240418_jpmse_regform_supplement_sv2.pdf),
- 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 17. April 2024, das von der CSSF gebilligt wurde,
- der JPMSP Jahresabschluss 2023,
- der JPMSP Jahresabschluss 2022,
- das JPMSE Registrierungsformular vom 2. Juni 2023, welches von der Zuständigen Behörde gebilligt wurde,
- der Dritte Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular, welcher von der Zuständigen Behörde gebilligt wurde,
- 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 werden die Positionen "JPMSF Registrierungsformular vom 19. April 2023", "JPMSF Jahresabschluss 2022*" und "JPMSF Jahresabschluss 2021*" wie folgt ersetzt:

"

Dokument	Einbezogene Abschnitte / Seite(n)	Abschnitt / Seite(n) im Basisprospekt
<i>JPMSF Registrierungsformular vom 17. April 2024</i>		
Cautionary Note Regarding Forward-Looking Statements	Vollständiger Abschnitt / Seiten 2 bis 3	Abschnitt XII. / Seite 315
Risk Factors	Abschnitte 1. bis 5. / Seiten 5 bis 41	Abschnitt II.A. / Seite 15
J.P. Morgan Structured Products B.V.	Vollständiger Abschnitt / Seiten 44 bis 47	Abschnitt XII. / Seite 315
<i>JPMSF Jahresabschluss 2023*</i>		
Directors' Report	Seiten 3 bis 9	Abschnitt XII. / Seite 315
Financial Statements:		
Balance Sheet	Seite 10	Abschnitt XII. / Seite 315
Income statement	Seite 11	Abschnitt XII. / Seite 315
Statement of comprehensive income	Seite 11	Abschnitt XII. / Seite 315
Statement of changes in equity	Seite 12	Abschnitt XII. / Seite 315
Statement of cash flows	Seite 13	Abschnitt XII. / Seite 315
Notes to the financial statements	Seiten 14 bis 37	Abschnitt XII. / Seite 315
Other information:		
Profit appropriation according to the Articles of Association	Seite 38	Abschnitt XII. / Seite 315
Independent auditor's report	Seiten 39 bis 50	Abschnitt XII. / Seite 315
<i>JPMSF Jahresabschluss 2022*</i>		
Directors' report	Seiten 3 bis 9	Abschnitt XII. / Seite 315
Financial statements:		
Balance sheet	Seite 10	Abschnitt XII. / Seite 315
Income statement	Seite 11	Abschnitt XII. / Seite 315
Statement of changes in equity	Seite 12	Abschnitt XII. / Seite 315
Statement of cash flows	Seite 13	Abschnitt XII. / Seite 315
Notes to the financial statements	Seiten 14 bis 37	Abschnitt XII. / Seite 315
Other information:		
Profit appropriation according to the Articles of Association	Seite 38	Abschnitt XII. / Seite 315
Independent auditor's report	Seiten 39 bis 50	Abschnitt XII. / Seite 315

"

- 4) *Unter "B. Informationen" in dem Unterabschnitt "4. Durch Verweis einbezogene Informationen" auf den Seiten 319 ff. des Basisprospekts werden die Positionen "Erster Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular", "Zweiter Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular", "Dritter Nachtrag zum JPMSP Registrierungsformular" und "Zweiter Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular" gelöscht.*
- 5) *Unter "B. Informationen" in dem Unterabschnitt "4. Durch Verweis einbezogene Informationen" auf den Seiten 319 ff. des Basisprospekts wird am Ende der Tabelle die folgende Position neu hinzugefügt:*

"

Dritter Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular

Informationen enthalten im Dritten
Nachtrag zum JPMSE
Registrierungsformular

Seiten 2 bis 3 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, Senckenberganlage 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.