

NACHTRAG NR. 3 VOM 16. MAI 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 geprüften Jahresabschlusses der J.P. Morgan SE für das am 31. Dezember 2023 geendete Geschäftsjahr (der "**JPMSE Jahresabschluss 2023**") am 13. Mai 2024 und (ii) die Veröffentlichung des Nachtrags Nr. 4 vom 14. Mai 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 JPMSE Jahresabschluss 2023 und die Informationen in dem Nachtrag Nr. 4 zum JPMSE Registrierungsformular werden mittels dieses Nachtrags in den Basisprospekt einbezogen.

I. 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**"), dem vierten Nachtrag vom 14. Mai 2024 zum JPMSE Registrierungsformular (der "**Vierte Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular**") und dem JPMSP Registrierungsformular sowie in dem geprüften Jahresabschluss der JPMSE für das am 31. Dezember 2023 geendete Geschäftsjahr (der "**JPMSE Jahresabschluss 2023**") und dem geprüften Jahresabschluss der JPMSE für das am 31. Dezember 2022 geendete Geschäftsjahr (der "**JPMSE Jahresabschluss 2022**") enthaltenen Informationen per Verweis in diesen Basisprospekt einbezogen (eine genaue Angabe der Seiten im JPMSE Registrierungsformular, dem Dritten Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular, dem Vierten Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular, dem JPMSP Registrierungsformular, dem JPMSE Jahresabschluss 2023 und dem JPMSE Jahresabschluss 2022, von denen Informationen per Verweis einbezogen werden, findet sich im Abschnitt "XIV. Allgemeine Informationen" unter "4. Durch Verweis einbezogene Informationen")."

II. 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 Vierte Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular (unter https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/240514_jpmse_regform_supplement_sv2.pdf),
- der JPMSE Jahresabschluss 2023 (<https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/2023-annual-report-english.pdf>),
- der JPMSE Jahresabschluss 2022 (unter <https://www.jpmorgan-zertifikate.de/globalassets/library/legal-documents/items/2022-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 Vierte Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular, welcher von der Zuständigen Behörde gebilligt wurde,
- der JPMSE Jahresabschluss 2023,
- der JPMSE Jahresabschluss 2022,
- 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 "JPMSE Jahresabschluss 2022*" und "JPMSE Jahresabschluss 2021*" wie folgt ersetzt:*

"

Dokument	Einbezogene Abschnitte / Seite(n)	Abschnitt / Seite(n) im Basisprospekt
<i>JPMSE Jahresabschluss 2023</i>		
Management report	Seiten 6 bis 96	Abschnitt XIII. / Seite 316
Assurance by the Management Board	Seiten 96 bis 98	Abschnitt XIII. / Seite 316
Financial statements:		
Income statement	Seite 100	Abschnitt XIII. / Seite 316
Balance sheet	Seite 101	Abschnitt XIII. / Seite 316
Changes in equity	Seite 102	Abschnitt XIII. / Seite 316
Cash flow statement	Seite 103	Abschnitt XIII. / Seite 316
Notes to the financial statements	Seiten 104 bis 225	Abschnitt XIII. / Seite 316
Independent auditors' report	Seiten 226 bis 233	Abschnitt XIII. / Seite 316
<i>JPMSE Jahresabschluss 2022</i>		
Management report	Seiten 8 bis 86	Abschnitt XIII. / Seite 316
Assurance by the Management Board	Seiten 87 bis 88	Abschnitt XIII. / Seite 316
Financial statements:		
Income statement	Seite 90	Abschnitt XIII. / Seite 316
Balance sheet	Seite 91	Abschnitt XIII. / Seite 316
Changes in equity	Seite 92	Abschnitt XIII. / Seite 316
Cash flow statement	Seite 93	Abschnitt XIII. / Seite 316
Notes to the financial statements	Seiten 94 bis 215	Abschnitt XIII. / Seite 316

Independent auditors' report

Seiten 216 bis
222

Abschnitt XIII. / Seite 316

"

- 4) *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:*

"

Vierter Nachtrag zum JPMSE Registrierungsformular

I. Amendments to section "IV. J.P.
MORGAN SE"

Ziffer 1)

Seiten 2 bis 7 Abschnitt XIII. / Seite 316

Ziffer 2)

Seite 7 Abschnitt XIII. / Seite 316

Ziffer 3)

Seite 7 Abschnitt XIII. / Seite 316

Ziffer 4)

Seite 8 Abschnitt XIII. / Seite 316

Ziffer 6)

Seite 8 Abschnitt XIII. / Seite 316

II. Amendments to section "V.
DOCUMENTS AVAILABLE"

Seiten 8 bis 9 Abschnitt XIII. / Seite 316

"

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.