

## Documento contenente le Informazioni Chiave (“KID”)

### Scopo

Il presente documento fornisce all'investitore le informazioni chiave sul presente prodotto di investimento. Non si tratta di un documento promozionale. Le informazioni sono richieste dalla legge allo scopo di aiutare l'investitore a comprendere la natura, i rischi, i costi, i guadagni e le perdite potenziali del presente prodotto e aiutare l'investitore a confrontarlo con altri prodotti.

### Prodotto

## 100% Certificato con Protezione del Capitale e Barriera in EUR su Cacao, Caffè, Soia

### Shark Note

Numero Valore Svizzero: 125733885 | ISIN: CH1257338850

Ideatore: **Leonteq Securities AG, Guernsey Branch, St. Peter Port, Guernsey**

Produttore del PRIIP: **Leonteq Securities AG** | Il produttore di PRIIP fa parte del Gruppo Leonteq. | [www.leonteq.com](http://www.leonteq.com) | telefono +41 58 800 1111 per ulteriori informazioni

| Autorità competente: Non applicabile. L'Ideatore del PRIIP è domiciliato in Svizzera ed è sottoposto alla vigilanza prudenziale dell'Autorità Federale di Vigilanza sui Mercati Finanziari ("FINMA"). La FINMA non è considerata un'autorità di vigilanza competente ai sensi del Regolamento UE 1286/2014 relativo ai documenti contenenti le informazioni chiave per i prodotti d'investimento al dettaglio e assicurativi preassemblati (PRIIP). | Data di realizzazione del documento contenente le informazioni chiave: 03.07.2024

**L'investitore sta acquistando un prodotto di natura complessa e che può essere di difficile comprensione.**

### 1. Cos'è questo prodotto?

#### Tipo

Questo prodotto è un *Swiss Uncertificated Security* (Titolo Svizzero Dematerializzato) ai sensi del Diritto Svizzero.

#### Durata

La durata del prodotto termina con la Data di Rimborso a meno che non sia stato estinto anticipatamente.

#### Obiettivi

L'obiettivo del prodotto è fornire all'investitore un diritto specifico in base a condizioni predefinite. Questo prodotto offre all'investitore un Regolamento monetario alla Data di Rimborso pari ad almeno l'Importo della Protezione del Capitale. Inoltre il prodotto offre all'investitore una partecipazione illimitata nell'incremento di rendimento dei Sottostanti. Il prodotto ha una durata predefinita e verrà rimborsato alla Data di Rimborso. Le possibilità di rimborso del prodotto sono le seguenti:

- Se l'Evento Barriera non si verifica e
  - Se la performance finale del paniere è negativa o zero, l'investitore riceverà un Regolamento monetario nella Moneta di Rimborso pari all'Importo della Protezione del Capitale.
  - Se la performance finale del paniere è positiva, l'investitore riceverà un Regolamento monetario nella Moneta di Rimborso pari alla somma di (a) la Partecipazione moltiplicata per la Performance Finale del Paniere et (b) Protezione del Capitale ulteriormente moltiplicato per il Valore Nominale. Pertanto il Regolamento monetario è calcolato come segue:  $\text{Prezzo di Emissione} \times (\text{Protezione del Capitale} + \text{Partecipazione} \times \text{Performance Finale del Paniere})$
- Se l'Evento Barriera si è verificato, l'investitore riceverà un pagamento in contanti nella moneta di rimborso, che equivale all'Importo di Protezione del Capitale più Importo della cedola rebate. Pertanto il Regolamento monetario è calcolato come segue:  $\text{Prezzo di Emissione} \times \text{Protezione del Capitale} + \text{Importo della Cedola rebate}$

Un Evento Barriera è considerato avvenuto quando, in qualsiasi momento nei Giorni Operativi della Borsa durante il periodo di Monitoraggio della Barriera, il Livello Paniere è pari o superiore alla propria Barriera, come determinato dall'Agente di Calcolo.

Il Livello Paniere corrisponde alla somma dei Prezzi dei Componenti Sottostanti. Per ciascun Componente Sottostante, il Prezzo è pari al prezzo di chiusura ufficiale del rispettivo Componente Sottostante nel relativo giorno operativo della borsa moltiplicato per il suo Fattore di ponderazione. La Performance Finale del Paniere è la somma dei Rendimenti dei Sottostanti. Per ciascun Sottostante il Rendimento è pari al Fattore di ponderazione del rispettivo Sottostante moltiplicato per la differenza tra (i) il Fixing Finale del rispettivo Sottostante diviso per il Fixing Iniziale e (ii) lo Strike Level (in %).

L'investitore potrebbe sostenere una perdita nel caso in cui la somma dell'importo del Regolamento in Contanti alla Data di Rimborso e dell'importo della cedola liquidato sia inferiore al prezzo di acquisto del prodotto. A differenza di un investimento diretto nei Sottostanti, l'investitore non riceverà alcun pagamento di dividendi né alcun ulteriore diritto risultante dai Sottostanti (ad es. diritti di voto).

|  |  |   |  |
|--|--|---|--|
| <b>Valuta del prodotto (Valuta di Regolamento)</b>                       | Euro ("EUR")   | <b>Lotto Minimo di Negoziazione / Investimento minimo</b> | 1 Certificato/i  |
| <b>Data di Emissione</b>   | 11.04.2023   | <b>Data del Fixing Iniziale</b>                           | 05.04.2023   |
| <b>Ultimo Giorno/Periodo di Negoziazione</b>                             | 04.10.2024 / Chiusura di mercato   | <b>Prima Data di Negoziazione di Mercato</b>              | 11.04.2023   |
| <b>Data di Rimborso</b>  | 11.10.2024   | <b>Data del Fixing Finale</b>                             | 04.10.2024   |
| <b>Prezzo di Emissione</b>   | EUR 1'000.00   | <b>Livello Paniere Iniziale</b>                           | EUR 1'000.00   |
| <b>Livello di Fixing Iniziale</b>  | Il prezzo di liquidazione ufficiale del rispettivo Sottostante alla Data di Fixing Iniziale della Borsa di Riferimento | <b>Livello di Fixing Finale</b>                           | Il prezzo di liquidazione ufficiale del rispettivo Sottostante alla Data di Fixing Finale della Borsa di Riferimento   |
| <b>Cedola rebate / data di pagamento e l'importo della cedola rebate</b> | 7.00% / EUR 70.00 versato 11.10.2024   | <b>Protezione del Capitale</b>                            | 100.00%  |
| <b>Importo della Protezione del Capitale</b>                             | EUR 1'000.00   | <b>Partecipazione</b>                                     | 100.00%  |
| <b>Modalità di Pagamento</b>   | Regolamento in Contanti  | <b>Periodo di Monitoraggio della Barriera</b>             | 05.04.2023 - 04.10.2024  |
| <b>Quotazione di borsa</b>   | Borsa Italiana S.p.A.; negoziato sul sistema multilaterale di negoziazione (MTF) EuroTLX®                              | <b>Rischio di Cambio</b>                                  | Il prodotto dispone di copertura valutaria alla scadenza, ossia sebbene il Livello di Fixing Iniziale sia determinato nella valuta del Sottostante, gli importi determinati nella valuta del Sottostante saranno convertiti 1:1 nella Valuta del Prodotto (Quanto) |
| <b>Livello Barriera</b>  | EUR 1'200.00 (120.00%)   |   |  |

| i | Sottostante   | Tipo                       | Borsa di Riferimento | Bloomberg Ticker | ISIN         | Livello di Fixing Iniziale (100%)* | Peso Iniziale | Ponderazione (W <sub>i</sub> ) |
|---|---|----------------------------|----------------------|------------------|--------------|------------------------------------|---------------|--------------------------------|
| 1 | <b>Cacao</b><br>Generico<br>contratto future<br>front | Future su<br>materie prime | CBOT                 | CC1 Comdty       | XD0002742035 | USD 2903.00                        | 33.33%        | 0.11482                        |
| 2 | <b>Caffè</b><br>Generico<br>contratto future<br>front | Future su<br>materie prime | ICE                  | KC1 Comdty       | XD0016549160 | USD 1.8015                         | 33.33%        | 185.03099                      |
| 3 | <b>Soia</b><br>Generico<br>contratto future<br>front  | Future su<br>materie prime | CBOT                 | S 1 Comdty       | US12492A1079 | USD 15.11                          | 33.33%        | 22.06045                       |

\*i livelli sono espressi in percentuale del Livello di Fixing Iniziale

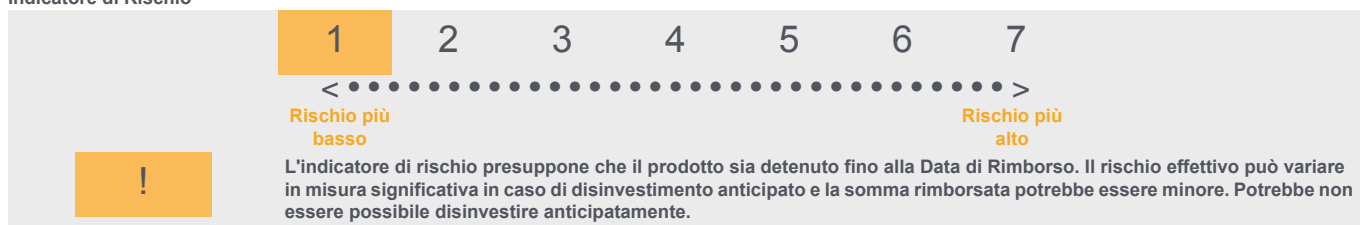
Le condizioni del prodotto prevedono che nel caso in cui si verificano certi eventi eccezionali (1) potrebbero essere apportate modifiche al prodotto e/o (2) l'Emittente del prodotto potrebbe terminare anticipatamente il prodotto. Tali eventi sono specificati nei termini del prodotto e riguardano principalmente il/i Sottostante/i, il prodotto e l'Emittente del prodotto. Questi eventi eccezionali sono, a titolo meramente esemplificativo e non esaustivo, la cessazione di un Sottostante, eventi fiscali e l'incapacità dell'Emittente di effettuare le operazioni di copertura necessarie. In caso di estinzione del prodotto, l'importo di rimborso potrebbe essere molto al di sotto del prezzo di acquisto. L'investitore sostiene inoltre il rischio che il prodotto venga estinto in un momento per lui sfavorevole e l'investitore potrebbe pertanto avere soltanto la possibilità di reinvestire l'importo di rimborso a condizioni meno favorevoli.

#### Per destinatari rappresentati da investitori al dettaglio

- Il prodotto è destinato agli investitori al dettaglio che intendono costituire un patrimonio privato e con un orizzonte di investimento a breve termine.
- L'investitore non può sostenere perdite pari all'importo dell'investimento o può sostenere solo perdite marginali di tale importo e attribuisce importanza ai prodotti con garanzia del capitale.
- CONOSCENZE & ESPERIENZA: Investitori che presentano almeno conoscenze basilari degli strumenti finanziari in questione (un investitore con conoscenze basilari è in grado di prendere decisioni d'investimento sulla base dei documenti previsti per legge o delle informazioni basilari fornite dal distributore). Non è richiesta alcuna esperienza nei mercati finanziari.

## 2. Quali sono i rischi e qual'è il potenziale rendimento?

### Indicatore di Rischio



L'indicatore sintetico di rischio è una guida al livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Mostra le probabilità che il prodotto perda valore a causa delle oscillazioni dei mercati o perché l'Emittente non è in grado di pagare l'investitore.

Abbiamo attribuito a questo prodotto un livello di rischio pari a 1 su 7, corrispondente alla classe di rischio più bassa.

Questo punteggio indica che le perdite potenziali derivanti dal rendimento futuro sono ad un livello molto basso, ed è pertanto molto improbabile che eventuali condizioni di mercato sfavorevoli influiscano sulla capacità dell'Emittente di rimborsare il prodotto all'investitore.

**L'investitore deve essere consapevole del rischio di valuta. Se l'investitore riceve pagamenti in una valuta differente, il rendimento finale che questi otterrà dipenderà dal tasso di cambio tra le due valute. Questo rischio non è contemplato nell'indicatore sopra riportato.**

L'investitore ha diritto di ricevere almeno il 100 % del capitale investito. Qualsiasi importo superiore e qualsiasi rendimento aggiuntivo dipende dalla performance futura del mercato e non può essere garantito. Tuttavia, tale protezione rispetto alla performance futura del mercato non si applicherà se l'investitore vende il prodotto prima della scadenza.

Se l'Emittente non è in grado di rimborsare all'investitore quanto dovuto, quest'ultimo potrebbe perdere tutto l'investimento. Per informazioni dettagliate su tutti i rischi, si prega di fare riferimento alla documentazione legale specificata nella sezione "Altre informazioni rilevanti".

### Scenari di Performance

Il rendimento dell'investitore dipenderà dall'andamento futuro dei mercati. L'andamento futuro dei mercati è incerto e non può essere previsto con esattezza. Gli scenari sono qui riportati a fini illustrativi e si basano su risultati del passato e su talune previsioni. Nel futuro i mercati potrebbero avere un andamento molto diverso.

| Periodo di detenzione raccomandato: | 11.10.2024  |
|-------------------------------------|---|
| Esempio di investimento:            | EUR 10'000  |
| Scenari                             | Se l'investitore esce dopo 11.10.2024   |
| <b>Minimo</b>                       | L'investitore ha il diritto di ricevere almeno il EUR 9'404. Il rendimento è garantito solamente se il prodotto è rimborsato alla scadenza e se l'Emittente è in grado di adempiere ai propri obblighi in base al prodotto (vedi Sezione 3 "Cosa accade se l'Emittente non è in grado di pagare?"). |
| <b>Stress</b>                       | Potenziale rendimento per l'investitore, dedotti i costi EUR 10060<br>Rendimento percentuale 0.63%  |
| <b>Sfavorevole</b>                  | Potenziale rendimento per l'investitore, dedotti i costi EUR 10060<br>Rendimento percentuale 0.63%  |
| <b>Moderato</b>                     | Potenziale rendimento per l'investitore, dedotti i costi EUR 10060<br>Rendimento percentuale 0.63%  |
| <b>Favorevole</b>                   | Potenziale rendimento per l'investitore, dedotti i costi EUR 10060<br>Rendimento percentuale 0.63%  |

I dati riportati includono tutti i costi inerenti al prodotto, ma potrebbero non includere tutti i costi sostenuti dall'investitore per il consulente o il distributore. I dati non tengono conto della situazione fiscale personale dell'investitore, che potrebbe inoltre influire sull'importo rimborsato all'investitore.

Lo scenario di stress indica quale potrebbe essere l'importo rimborsato all'investitore in circostanze di mercato estreme.

Gli scenari mostrati rappresentano possibili risultati calcolati sulla base di simulazioni.

### 3. Cosa succede se l'Emittente non è in grado di corrispondere quanto dovuto?

L'investitore è esposto al rischio che l'Emittente possa non essere in grado di adempiere alle obbligazioni derivanti dal prodotto ad esempio in caso di insolvenza (incapacità di pagare/sovraindebitamento) o di provvedimento amministrativo. È possibile che l'investitore subisca una perdita totale del capitale investito. Il prodotto è uno strumento di debito e come tale non è coperto da un programma di protezione dei depositi.

### 4. Quali sono i costi?

La persona che consiglia l'investitore in merito al prodotto o che vende il prodotto all'investitore potrà addebitare a quest'ultimo ulteriori costi. In questo caso fornirà all'investitore informazioni su tali costi, illustrandone l'impatto sull'investimento.

#### Costo nel tempo

Le tabelle mostrano gli importi prelevati dall'investimento dell'investitore per coprire diversi tipi di costi. Tali importi dipendono da quanto l'investitore investe, per quanto tempo detiene il prodotto e dall'andamento dello stesso. Gli importi sono qui riportati a fini illustrativi e si basano su un investimento con un importo esemplificativo e su diversi possibili periodi di investimento.

Si è ipotizzato quanto segue:

- Nel primo anno l'investitore recupera l'importo investito (rendimento annuo dello 0%). Per gli altri periodi di detenzione abbiamo ipotizzato che la performance del prodotto sia quella mostrata nello scenario moderato.
- Investimento di EUR 10'000

|                         | Se l'investitore esce dopo il periodo di detenzione raccomandato |
|-------------------------|--|
| Costi totali            | EUR 47   |
| Incidenza dei costi (*) | 0.5%   |

(\*) Illustra l'effetto dei costi per un periodo di detenzione inferiore a un anno. Questa percentuale non può essere direttamente confrontata con i dati relativi all'incidenza dei costi forniti per altri prodotti.

Una parte dei costi può essere condivisa con la persona che vende il prodotto all'investitore per coprire i servizi che tale persona fornisce a quest'ultimo. Questa persona informerà l'investitore dell'importo.

#### Composizione dei Costi

| Costi una tantum di entrata o di uscita |   | Se l'investitore esce dopo 11.10.2024 |
|---|---|---------------------------------------|
| Costi di entrata                        | 0.5% dell'importo pagato dall'investitore al momento della sottoscrizione dell'investimento.<br>Questi costi sono già inclusi nel prezzo che l'investitore paga.                | Fino a EUR 47                         |
| Costi di uscita                         | I costi di uscita sono indicati come EUR 0 nella colonna successiva in quanto non si applicano se l'investitore detiene il prodotto fino al periodo di detenzione raccomandato. | EUR 0                                 |

### 5. Per quanto tempo l'investitore dovrebbe detenere il prodotto e può ritirare il capitale prematuramente?

#### Periodo di detenzione raccomandato: 3 mesi 8 giorni (fino alla Data di Rimborso 11.10.2024)

L'obiettivo del prodotto è fornire all'investitore il profilo di rimborso descritto al precedente punto "1. Cos'è questo prodotto?". La capacità di beneficiare del profilo di rimborso si applica solo se il prodotto è detenuto fino alla scadenza. Non è sempre opportuno confrontare le prestazioni o le cifre di costo di questo prodotto con altri prodotti con periodi di conservazione consigliati diversi.

Non esistono altre possibilità di disinvestimento anticipato se non tramite la vendita del prodotto sulla borsa su cui il prodotto è quotato o fuori borsa.

In normali condizioni di mercato, il prezzo al quale l'investitore potrebbe vendere il prodotto dipenderà dai parametri di mercato prevalenti, che potrebbero mettere a rischio l'importo investito. In particolari condizioni di mercato, o in caso di problemi tecnici/interruzioni del servizio, può essere temporaneamente difficile o impossibile vendere e/o acquistare il prodotto.

### 6. Come può l'investitore presentare reclamo?

Qualsiasi reclamo riguardante il soggetto che fornisce consulenza sul prodotto o che lo commercializza tramite il relativo sito internet può essere inoltrato direttamente a tale soggetto.

Qualsiasi reclamo relativo al prodotto o alla gestione di tale prodotto da parte dell'Emittente può essere inoltrato al seguente indirizzo: Leonteq Securities AG, Europaallee 39, 8004 Zurigo, Svizzera, kid@leonteq.com, www.leonteq.com.

### 7. Altre informazioni rilevanti

Qualsiasi documentazione aggiuntiva relativa al prodotto e in particolare le condizioni definitive e il prospetto di base (inclusi eventuali supplementi agli stessi) è pubblicata sul sito internet dell'Emittente (www.leonteq.com). Per ottenere informazioni più specifiche, e in particolare dettagli sulla struttura e sui rischi associati a un investimento nel prodotto, si invita l'investitore a consultare tali documenti. Inoltre, Leonteq Securities AG ha elaborato il KID sulla base di alcune assunzioni ed esercitando una certa discrezionalità in relazione ai calcoli delle cifre chiave e degli scenari di performance. Il Produttore del PRIIP rivaluterà e adeguerà le proprie ipotesi come riterrà di volta in volta opportuno.

Il Prodotto non è classificato come sostenibile. Non viene fornita alcuna dichiarazione in merito alla sostenibilità del Prodotto o di un Sottostante, ai sensi del Regolamento (UE) 2020/852 (Regolamento sulla tassonomia), del Regolamento (UE) 2019/2088 (Regolamento sull'Informativa sulla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari) o di qualsiasi altra norma di legge o di regolamento relativo alla sostenibilità. Qualsiasi riferimento a termini attinenti alla sostenibilità per quanto concerne il Prodotto o un Sottostante non implicherà che tale dichiarazione sia stata fornita dall'Emittente, dal Lead Manager o dal Garante, a seconda dei casi. Si specifica inoltre che il Prodotto non è indirizzato a clienti con specifiche esigenze riguardanti preferenze di sostenibilità ai sensi dell'art. 2, n. 7 del Regolamento Delegato MiFID II (UE) 2017/565.