

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 partecipazione in EUR su Alluminio, Rame, Zinco

Numero Valore Svizzero: 134997759 | ISIN: CH1349977590

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 | 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: 24.05.2024

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 con cap nell'incremento di rendimento del Sottostante. Il prodotto ha una durata predefinita e verrà rimborsato alla Data di Rimborso. Le possibilità di rimborso del prodotto sono le seguenti:

- Se il Livello di Fixing Finale del Sottostante caratterizzato dal Rendimento Peggioro è uguale o inferiore al Fixing Iniziale rispettivo, l'investitore riceverà un Regolamento monetario nella Moneta di Rimborso pari all'Importo della Protezione del Capitale.
- Se il Livello di Fixing Finale del Sottostante caratterizzato dal Rendimento Peggioro è superiore al Fixing Iniziale rispettivo, ma uguale o inferiore al Fixing Iniziale rispettivo moltiplicato con il cap level (in %), l'investitore riceverà un Regolamento monetario nella Moneta di Rimborso pari all'Importo della Protezione del Capitale più l'Importo della Partecipazione.
L'Importo della Partecipazione è pari al Valore Nominale moltiplicato per il rendimento del Sottostante con il Rendimento Peggioro che supera il Fixing Iniziale e ulteriormente moltiplicato per la Partecipazione. Pertanto il Regolamento monetario è calcolato come segue:
 $\text{Valore Nominale} \times (\text{Protezione del Capitale} + \text{Partecipazione} \times (\text{Fixing Finale del Sottostante con il Rendimento Peggioro} - \text{Fixing Iniziale del Sottostante con il Rendimento Peggioro}) / \text{Fixing Iniziale del Sottostante con il Rendimento Peggioro})$.
- Se il Livello di Fixing Finale del Sottostante caratterizzato dal Rendimento Peggioro è superiore al Fixing Iniziale rispettivo moltiplicato con il cap level (in %), l'investitore riceverà un Regolamento monetario nella Moneta di Rimborso pari all'Importo della Protezione del Capitale più l'Importo della Partecipazione. L'Importo della Partecipazione è pari al Prezzo di Emissione moltiplicato per la differenza tra (a) il Cap level (in %) e (b) il 100% e ulteriormente moltiplicato per la Partecipazione. Pertanto il Regolamento monetario è calcolato come segue: $\text{Prezzo di Emissione} \times (\text{Protezione del Capitale} + \text{Partecipazione} \times (\text{Livello Cap (in \%)} - 100\%))$.

L'investitore potrebbe sostenere una perdita nel caso in cui il Regolamento monetario alla Data di Rimborso sia inferiore al prezzo di acquisto del prodotto. A differenza di un investimento diretto nei Sottostanti, l'investitore non beneficerà del pagamento di dividendi né di qualsiasi ulteriore diritto risultante dai Sottostanti (ad es. diritti di voto).

| | | | |
|--|--|---|--|
| Valuta del prodotto (Valuta di Regolamento) | Euro ("EUR") | Lotto Minimo di Negoziazione / Investimento minimo | 1 Certificato/i |
| Data di Emissione | 27.05.2024 | Data del Fixing Iniziale | 21.05.2024 |
| Ultimo Giorno/Periodo di Negoziazione | 20.05.2027 / Chiusura di mercato | Prima Data di Negoziazione di Mercato | 27.05.2024 |
| Data di Rimborso | 27.05.2027 | Data del Fixing Finale | 20.05.2027 |
| Prezzo di Emissione | EUR 100.00 | Livello di Fixing Iniziale | Il prezzo di liquidazione ufficiale del rispettivo Sottostante alla Data di Fixing Iniziale della Borsa di Riferimento |
| Livello di Fixing Finale | Il prezzo di liquidazione ufficiale del rispettivo Sottostante alla Data di Fixing Finale della Borsa di Riferimento | Importo di Rimborso Massimo | EUR 160.00 |
| Protezione del Capitale | 100.00% | Importo della Protezione del Capitale | EUR 100.00 |
| Partecipazione | 100.00% | Livello Cap | 160.00% |
| Modalità di Pagamento | Regolamento in Contanti | Quotazione di borsa | Borsa Italiana S.p.A.; negoziato sul sistema multilaterale di negoziazione (MTF) EuroTLX® |
| Performance Peggioro | Per ciascun Sottostante, il rendimento è calcolato dividendo il proprio Livello di Fixing Finale per il rispettivo Livello di Fixing Iniziale. La Performance peggioro corrisponde al più basso tra tutti i valori così calcolati. | Rischio di Cambio | 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) |

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 1 anno | Se l'investitore esce dopo il periodo di detenzione raccomandato |
|---------------------------------|-----------------------------------|--|
| Costi totali | EUR 510 | EUR 460 |
| Incidenza annuale dei costi (*) | 5.3% | 1.6% Ogni anno |

(*) Dimostra come i costi riducano ogni anno il rendimento dell'investitore nel corso del periodo di detenzione. Mostra, ad esempio, che se l'investitore esce nel periodo di detenzione raccomandato, il rendimento medio annuo è previsto pari al 1.6% al lordo dei costi e al 0.0% al netto dei costi.

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.

Questi dati includono la commissione di distribuzione massima che la persona che vende il prodotto all'investitore potrà addebitargli. (3.0 % dell'importo investito/EUR 300).

Questa persona informerà l'investitore riguardo all'effettiva commissione di distribuzione.

Composizione dei Costi

| Costi una tantum di entrata o di uscita | Se l'investitore esce dopo 1 anno |
|---|--|
| Costi di entrata | <p>4.6% dell'importo pagato dall'investitore al momento della sottoscrizione dell'investimento.</p> <p>Questi costi sono già inclusi nel prezzo che l'investitore paga.</p> <p>Questi dati includono la commissione di distribuzione massima che la persona che vende il prodotto all'investitore potrà addebitargli. 3.0% dell'importo investito / EUR 300.</p> <p>Questa persona informerà l'investitore riguardo all'effettiva commissione di distribuzione.</p> <p>EUR 460</p> |
| Costi di uscita | <p>I costi di uscita sono stimati pari al 0.5% dell'investimento prima della distribuzione all'investitore. Questi costi sono già inclusi nel prezzo che l'investitore riceverà e saranno dovuti solo in caso di uscita prima della scadenza. Se l'investitore detiene il prodotto fino alla scadenza, non sosterrà costi di uscita.</p> <p>EUR 50</p> |

5. Per quanto tempo l'investitore dovrebbe detenere il prodotto e può ritirare il capitale prematuramente?**Periodo di detenzione raccomandato: 27.05.2027 (fino alla Data di Rimborso)**

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 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.