

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

5.30% p.a. Credit Linked Certificate in EUR su Banco BPM SpA SUB (Subordinato)

Numero Valore Svizzero: 134998981 | ISIN: CH1349989819

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: 15.10.2024

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 il prodotto non sia stato estinto o rimborsato anticipatamente. L'Emittente ha il diritto di rimborsare il prodotto anticipatamente ad ogni Giorno di monitoraggio per il Rimborso Anticipato.

Obiettivi

Il prodotto è collegato al merito di credito di Banco BPM SpA SUB quale Entità di Riferimento ("Entità di Riferimento"). Salvo in caso di un Evento di Credito, la durata del prodotto è fissa e il prodotto sarà rimborsato alla Data di Rimborso.

1) Se non si è verificato un Evento di Credito, alla Data di Rimborso l'investitore riceverà il 100 per cento all'Importo di Riferimento e il pagamento della cedola al tasso annuo alla Data di Pagamento della Cedola. Salvo in caso di un Evento di Credito, la durata del prodotto è fissa e il prodotto sarà rimborsato alla Data di Rimborso.

2) Al verificarsi di un Evento di Credito durante il Periodo di Osservazione degli Eventi di Credito o in caso di pubblicazione di un Avviso di Evento di Credito da parte dell'Agente di Calcolo, il prodotto verrà liquidato. In questo caso, le cedole cesseranno di maturare a partire dalla data in cui si considera verificato l'Evento di Credito (Data di determinazione dell'Evento). Inoltre, l'importo del rimborso non corrisponderà più all'Importo di Riferimento ma all'Importo di liquidazione.

Il verificarsi di un Evento di Credito sarà determinato dall'Agente di Calcolo sulla base di informazioni di pubblico dominio o di annunci rilasciati dalla International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA). L'ISDA ha creato un Comitato (l'ISDA Credit Derivatives Determinations Committee) composto da istituti finanziari e altri operatori con una presenza significativa nel mercato dei derivati di credito. Il suddetto Comitato è responsabile, tra l'altro, delle decisioni applicabili a tutto il mercato in merito al verificarsi di eventi considerati eventi di credito ai sensi degli standard dell'ISDA.

Gli Eventi di credito ai fini dei prodotti corrispondono a quelli previsti dagli standard di mercato dell'ISDA e comprendono *inter alia* i seguenti eventi:

- **Bankruptcy** - Comprende tutti i casi di insolvenza (ad esempio incapacità di assolvere a obblighi di pagamento o indebitamento eccessivo), liquidazione, composizione con i creditori e procedimenti esecutivi a carico dei beni dell'Entità di Riferimento, ad esempio in conseguenza al mancato versamento di pagamenti dovuti a fronte di obbligazioni, prestiti o altre tipologie di debito.
- **Failure to Pay** - Si verifica se gli obblighi di pagamento nei confronti dei creditori, ad esempio in relazione a prestiti obbligazionari o bancari non sono rispettati, sia in caso di mora di pagamento o mancato pagamento.
L'importo rimborsabile potrebbe anche essere pari a zero. Qualora si verifichi un Evento di Credito il rimborso potrà essere rimandato sino a quando non sia stato determinato l'Importo di liquidazione.

Rimborso anticipato:

In ciascuna Data di Rimborso Anticipato dell'Emittente, questo ha il diritto, ma non l'obbligo, di rimborsare tutti i Certificati per rimborso anticipato alla rispettiva Data di Rimborso Anticipato. Alla Data applicabile Rimborso Anticipato l'Investitore riceverà un Pagamento in contanti nella Moneta di Rimborso uguale al Valore Nominale maggiorato dell'Importo della Cedola, se applicabile, in corrispondenza alla rispettiva Data di Pagamento della Cedola. Non verranno effettuati ulteriori pagamenti.

| | | | |
|--|---|---|--|
| Valuta del prodotto (Valuta di Regolamento) | Euro ("EUR") | Lotto Minimo di Negoziazione / Investimento minimo | 1 Certificato/i |
| Data di Emissione | 18.07.2024 | Data del Fixing Iniziale | 09.07.2024 |
| Ultimo Giorno/Periodo di Negoziazione | 20.06.2029 / Chiusura di mercato | Prima Data di Negoziazione di Mercato | 18.07.2024 |
| Data di Rimborso programmata | In corrispondenza alla prima delle seguenti date: a) 11.07.2029 b) in caso di esercizio del Diritto di Recesso dell'Emittente, la data indicata come Data di Rimborso Anticipato nell'Avviso di Recesso dell'Emittente ("Data di Rimborso Anticipato"). Qualora durante il Periodo di Osservazione degli Eventi di Credito si sia verificato un Evento di Credito, la Data di Rimborso per Eventi di Credito | Data del Fixing Finale | 20.06.2029 |
| Prezzo di Emissione | EUR 1'000.00 | Importo di Riferimento | EUR 1'000.00 |
| Importo della cedola | Importo di Riferimento moltiplicato per la Cedola maturata | Data di Rimborso per Evento di Credito | La data che si verifica più tardi tra a) la Data di Rimborso prevista e b) la data che cade dieci Giorni lavorativi dopo la data in cui è stato calcolato l'Importo della liquidazione |
| Periodo di Osservazione degli Eventi di Credito | Si intende il periodo che va dal sessantesimo giorno solare (incluso) prima della Scadenza del fixing alla Data di estensione (inclusa) (come definita nelle Definizioni ISDA). Ai fini della determinazione della Data di estensione, il 20 giugno 2029 sarà considerata quale Data di recesso programmato. | Tipo di transazione | STANDARD EUROPEAN FINANCIAL CORPORATE |

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 1 anno | Se l'investitore esce dopo il periodo di detenzione raccomandato |
|---------------------------------|-----------------------------------|--|
| Costi totali | EUR 493 | EUR 444 |
| Incidenza annuale dei costi (*) | 5.2% | 1.0% 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 5.8% al lordo dei costi e al 4.8% 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.

Composizione dei Costi

| Costi una tantum di entrata o di uscita | | Se l'investitore esce dopo 1 anno |
|---|---|-----------------------------------|
| Costi di entrata | 4.4% dell'importo pagato dall'investitore al momento della sottoscrizione dell'investimento. Questi costi sono già inclusi nel prezzo che l'investitore paga. | EUR 444 |
| Costi di uscita | 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. | EUR 49 |

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

Periodo di detenzione raccomandato: 11.07.2029 (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?". Tale profilo di rimborso favorevole 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.