

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

Aperto Certificato Tracker in EUR su Open Active ETF Trackers Index

Numero Valore Svizzero: 138183556 | ISIN: CH1381835565

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: 04.10.2024

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

Il prodotto non ha una durata prefissata e sarà rimborsato dopo che l'investitore ha esercitato il prodotto o l'Emittente ha proceduto alla risoluzione dello stesso.

Obiettivi

Obiettivi del prodotto è fornire all'investitore un diritto specifico in base a condizioni predefinite. Questo prodotto consente all'investitore di partecipare ai movimenti di prezzo del Sottostante ed è pertanto, in termini di rischio, paragonabile a un investimento diretto nel Sottostante.

Alla Data di Rimborso, l'Investitore riceverà un Pagamento in Contanti (l'“Importo del Rimborso”) nella Valuta di Liquidazione. Il Pagamento in Contanti è calcolato moltiplicando (i) il Livello di Fixing Finale per (ii) le Unità e (iii) il Tasso di Cambio Finale e deducendo la Commissione di Management e la Commissione di Performance. La Commissione di Management e la Commissione di Performance riducono l'Importo del Rimborso basato sul periodo di possesso e hanno un effetto negativo sul prezzo sul mercato secondario.

Ciascun investitore ha il diritto di richiedere il rimborso del prodotto (il “Rimborso dell'Investitore”) ogni Giorno Lavorativo tramite annuncio (l'“Avviso di Rimborso”).

L'Emittente può richiamare tutti i prodotti a partire da qualsiasi Giorno Lavorativo tramite annuncio effettuato un mese prima dell'esercizio del suo diritto di recesso (l'“Annuncio di Rimborso”), specificando la Data di Rimborso (il “Rimborso dell'Emittente”).

A differenza di un investimento diretto nel Sottostante, l'investitore non beneficerà del pagamento di dividendi né di qualsiasi ulteriore diritto risultante dal Sottostante (ad es. diritti di voto). L'investitore parteciperà all'evoluzione del prezzo di mercato del Sottostante.

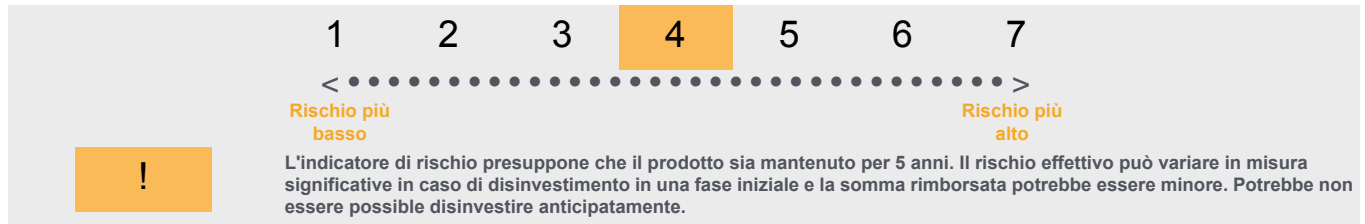
| | | | | |
|--|---|---|---|---|
| Valuta del prodotto (Valuta di Regolamento) | Euro (“EUR”) | Lotto Minimo di Negoziazione / Investimento minimo | 1 Certificato/i | |
| Data di Emissione | 11.10.2024 | Data del Fixing Iniziale | 08.10.2024 | |
| Ultimo Giorno/Periodo di Negoziazione | Aperto | Prima Data di Negoziazione di Mercato | 11.10.2024 | |
| Data di Rimborso | Indica il 5° Giorno lavorativo successivo alla Scadenza (soggetta alle previsioni in materia di Eventi di Turbativa del Settlement) | Data del Fixing Finale | Senza scadenza, o in caso di esercizio del Diritto di Recesso dell'Emittente, come specificato nella Comunicazione di Recesso dell'Emittente, o, in caso di esercizio del Diritto di Recesso dell'Investitore, la data in cui l'esercizio di tale Diritto di Recesso dell'Investitore diviene efficace (soggetta alle previsioni in materia di Eventi di Turbativa del Mercato) | |
| Prezzo di Emissione | EUR 1'000.00 | Livello di Fixing Iniziale | Chiusura ufficiale del rispettivo Sottostante alla Data del Fixing Iniziale nella relativa Borsa di Riferimento. | |
| Livello di Fixing Finale | Prezzo di chiusura ufficiale del Sottostante alla Scadenza come calcolato e pubblicato dallo Sponsor dell'Indice. | Modalità di Pagamento | Regolamento in Contanti | |
| Quotazione di borsa | Borsa Italiana S.p.A.; negoziato sul sistema multilaterale di negoziazione (MTF) SeDeX | Tasso di Cambio | Il Tasso di Cambio Prevalente il giorno di calendario utilizzato per scambiare la valuta del Sottostante nella Valuta di Liquidazione, secondo quanto ragionevolmente determinato dall'Emittente. Per un Sottostante quotato nella Valuta di Liquidazione questo valore sarà uguale ad 1. | |
| Commissione di Performance (PF) | 20.00% | Commissione di Management (MF) | 2.50% p.a. | |
| Unità Iniziale (Unità₀) | 1.00 | | | |
| Sottostante | Tipo | Sponsor dell'Indice | Bloomberg Ticker | Livello di Fixing Iniziale (100%)* |
| Open Active ETF Trackers Index | Indice | Leonteq Securities AG | DONMULTI | EUR TBA |

* verrà determinato alla Data del Fixing Iniziale (livelli espressi nella percentuale del 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. È anche possibile la perdita totale dell'investimento. 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 lungo termine.
- L'investitore può sopportare perdite fino alla perdita totale dell'importo investito e non attribuisce alcuna importanza ai prodotti con protezione 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 4 su 7, corrispondente a una classe di rischio media.

Questo punteggio indica che le perdite potenziali derivanti dal rendimento futuro sono ad un livello medio, e che eventuali condizioni di mercato sfavorevoli non dovrebbero influire 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.

Questo prodotto non prevede alcun meccanismo di protezione rispetto all'andamento futuro del mercato, pertanto l'investitore potrebbe perdere, totalmente o parzialmente, il proprio investimento.

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 che l'investitore otterrà dal presente prodotto dipenderà dall'andamento futuro dei mercati. L'andamento futuro dei mercati è incerto e non può essere previsto accuratamente. Lo scenario sfavorevole, lo scenario moderato e lo scenario favorevole riportati sono illustrazioni basate sul rendimento peggiore, il rendimento medio e il rendimento migliore del prodotto e/o di un parametro di riferimento idoneo e/o di un proxy idoneo negli ultimi 10 anni. Nel futuro i mercati potrebbero avere un andamento molto diverso.

| Periodo di detenzione raccomandato: | 5 anni | |
|-------------------------------------|--|--|
| Esempio di investimento: | EUR 10'000 | |
| Scenari | Se l'investitore esce dopo 1 anno | Se l'investitore esce dopo 5 anni (Periodo di Detenzione Raccomandato) |
| Minimo | Non c'è un rendimento minimo garantito. L'investitore potrebbe perdere tutto o parte del suo investimento. | |
| Stress | Potenziale rendimento per l'investitore, dedotti i costi | EUR 3660 |
| | Rendimento medio annuale | -63.22% |
| Sfavorevole * | Potenziale rendimento per l'investitore, dedotti i costi | EUR 7000 |
| | Rendimento medio annuale | -29.84% |
| Moderato ** | Potenziale rendimento per l'investitore, dedotti i costi | EUR 9940 |
| | Rendimento medio annuale | -0.55% |
| Favorevole *** | Potenziale rendimento per l'investitore, dedotti i costi | EUR 14980 |
| | Rendimento medio annuale | 49.44% |
| | | EUR 1590 |
| | | -30.73% |
| | | EUR 5990 |
| | | -9.75% |
| | | EUR 10500 |
| | | 0.98% |
| | | EUR 12800 |
| | | 5.06% |

* Per periodi di detenzione intermedi di 1 anno, questo tipo di scenario si è verificato per un investimento in Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR Index tra il Marzo 2019 e il Marzo 2020.

** Per il periodo di detenzione raccomandato, questo tipo di scenario si è verificato per un investimento in Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR Index tra il Marzo 2015 e il Marzo 2020.

*** Per periodi di detenzione intermedi di 1 anno, questo tipo di scenario si è verificato per un investimento in Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR Index tra il Gennaio 2016 e il Gennaio 2017.

*** Per il periodo di detenzione raccomandato, questo tipo di scenario si è verificato per un investimento in Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR Index tra il Agosto 2018 e il Agosto 2023.

*** Per periodi di detenzione intermedi di 1 anno, questo tipo di scenario si è verificato per un investimento in Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR Index tra il Marzo 2020 e il Aprile 2021.

*** Per il periodo di detenzione raccomandato, questo tipo di scenario si è verificato per un investimento in Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR Index tra il Novembre 2016 e il Novembre 2021.

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.

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 5 anni (Periodo di Detenzione Raccomandato) |
|---------------------------------|-----------------------------------|--|
| Costi totali | EUR 535 | EUR 1'658 |
| Incidenza annuale dei costi (*) | 5.5% | 3.1% 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 4.1% al lordo dei costi e al 1.0% 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.

Composizione dei Costi

| Costi una tantum di entrata o di uscita | Se l'investitore esce dopo 1 anno | |
|---|---|----------------|
| Costi di entrata | 2.4% dell'importo pagato dall'investitore al momento della sottoscrizione dell'investimento. Questi costi sono già inclusi nel prezzo che l'investitore paga. | Fino a EUR 240 |
| 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 50 |
| Costi correnti registrati ogni anno | | |
| Commissioni di gestione e altri costi amministrativi o di esercizio | 2.5% del valore dell'investimento all'anno. Si tratta di una stima basata sui costi effettivi. Tali costi sono illustrati alla sezione 1. "Cos'è questo prodotto?" sopra. | EUR 251 |
| Costi di transazione | Non applicabile | |

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

Periodo di detenzione raccomandato: 5 anni

L'investitore medio detiene questo tipo di prodotto per circa 5 anni in media. Questo periodo consente inoltre di rendere più preciso il confronto con altri prodotti di investimento senza una durata prestabilita. L'investitore ha la possibilità di richiamare i prodotti conformemente alle "Disposizioni di Recesso dell'Investitore" come descritto al precedente punto "1. Cos'è questo prodotto?". Inoltre il prodotto può essere venduto nella borsa dove è quotato il prodotto 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.

Il Sottostante è un marchio protetto dello Sponsor dell'Indice. Il prodotto non è sponsorizzato, approvato, venduto o promosso dal licenziante dell'indice il quale non rilascia alcuna garanzia in merito all'opportunità di investire nel prodotto, declinando a tal fine ogni responsabilità.

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.