

## Meccanismo di rimborso a scadenza per singola unità di Certificato



Informazioni chiave:

- **ISIN:** [CH1336239418](#)
- **Par Value:** EUR 1'000 (lotto minimo di negoziazione)
- **Denominazione del certificato:** EUR 1'000
- **Prezzo di emissione:** EUR 1'000
- **Sottostante:** 2.45% BTPS Italia (09/01/50)
- **Strike price:** 72.8725% dirty (spot 71.2042%)
- **Conversion Ratio:** 1.3723
- **Coupon:** 8.00% p.a. garantito

A scadenza, se il Final Fixing Level del bond è pari o inferiore allo Strike Price l'Investitore riceverà un numero di unità intero (pari al Conversion Ratio) del bond sottostante. La parte di Conversion Ratio non rimborsabile fisicamente a causa del taglio minimo del bond sarà consegnata in cash.

### Scenario 1

Final Fixing Level = 75%  
(superiore allo Strike price)



Rimborso del 100% del  
nozionale in cash



Rimborso pari a **EUR 1'000 (+ cedola garantita, pari a EUR 6.67 al mese)**

### Scenario 2

Final Fixing Level = 69% (inferiore allo Strike price)  
Conversion Ratio = **1.3723**



**1** lotto del bond, consegnato con Prezzo di Carico pari allo Strike Price (72.4398%) e valore di mercato pari al 69.00% (1 x 69.00% x EUR 1'000 = **EUR 690.00**) + Cedola maturata a scadenza (1 x EUR 1'000 x 0.4327% = **EUR 4.33**)

la parte rimanente del Conversion Ratio (**0.3723**) non è fisicamente consegnabile tramite il Bond (che ha taglio minimo EUR 1'000) ed è perciò consegnata in cash (0.3723 \* EUR 1'000 \* 69.00% = **EUR 256.89**)



Valore di mercato del rimborso finale **EUR 951.22 (+ cedola garantita, pari a EUR 6.67 al mese)**

## Meccanismo di rimborso a scadenza per singola unità di Certificato



Informazioni chiave:

- **ISIN:** [CH1423921233](#)
- **Par Value:** EUR 1.00 (lotto minimo di negoziazione)
- **Denominazione del certificato:** EUR 1'000
- **Prezzo di emissione:** EUR 850
- **Sottostante:** 0.5% France Govt (05/25/2072)
- **Strike price:** 39.00% (spot 29.78%)
- **Conversion Ratio:** 2'537.7168
- **Coupon:** 8.00% p.a. garantito

A scadenza, se il Final Fixing Level del bond è pari o inferiore allo Strike Price l'Investitore riceverà un numero di unità intero (pari al Conversion Ratio) del bond sottostante. La parte di Conversion Ratio non rimborsabile fisicamente a causa del taglio minimo del bond sarà consegnata in cash.

### Scenario 1

Final Fixing Level = 41%  
(superiore allo Strike price)



Rimborsamento del 100% del  
nozionale in cash



Rimborsamento pari a **EUR 1'000 (+ cedola garantita, pari a EUR 6.67 al mese)**

### Scenario 2

Final Fixing Level = 32% (inferiore allo Strike price)  
Conversion Ratio = **2'537.7168**



**2'537** lotti del bond, consegnati con Prezzo di Carico pari allo Strike Price (39.00%) e valore di mercato pari al 32.00% ( $2'537 \times 32.00\% \times \text{EUR } 1.00 = \text{EUR } 811.84$ ) + Cedola maturata a scadenza ( $2'537 \times \text{EUR } 1.00 \times 0.4055\% = \text{EUR } 10.29$ )

la parte rimanente del Conversion Ratio (**0.7168**) non è fisicamente consegnabile tramite il Bond (che ha taglio minimo EUR 1.00) ed è perciò consegnata in cash ( $0.7168 \times \text{EUR } 1.00 \times 32.00\% = \text{EUR } 0.23$ )



Valore di mercato del rimborso finale **EUR 822.36 (+ cedola garantita, pari a EUR 6.67 al mese)**

## Meccanismo di rimborso a scadenza per singola unità di Certificato



Informazioni chiave:

- **ISIN:** [CH1325427644](#)
- **Par Value:** EUR 0.01 (lotto minimo di negoziazione)
- **Denominazione del certificato:** EUR 1'000
- **Prezzo di emissione:** EUR 1'000
- **Sottostante:** 0% Bundesrepublik Deutschland (08/15/2052)
- **Strike price:** 51.2752%
- **Conversion Ratio:** 195'026.0555
- **Coupon:** 9.00% p.a. garantito

A scadenza, se il Final Fixing Level del bond è pari o inferiore allo Strike Price l'Investitore riceverà un numero di unità intero (pari al Conversion Ratio) del bond sottostante. La parte di Conversion Ratio non rimborsabile fisicamente a causa del taglio minimo del bond sarà consegnata in cash.

### Scenario 1 (ipotetico)

Final Fixing Level = 53%  
(superiore allo Strike price)



Rimborso del 100% del  
nozionale in cash



Rimborso pari a **EUR  
1'000 (+ cedola garantita,  
pari a 7.50 EUR al mese)**

**NON VERIFICATO**

### Scenario 2 (realizzato)

Final Fixing Level = 44.1116% (inferiore allo Strike price)  
Conversion Ratio = **195'026.0555**



**195'026** lotti del bond,  
consegnati con Prezzo di  
Carico pari allo Strike Price  
(51.2752%) e valore di mercato  
pari al 44.1116% ( $195'026 \times$   
 $44.1116\% \times \text{EUR } 0.01 = \text{EUR}$   
**860.29**)

la parte rimanente del  
Conversion Ratio (**0.0555**) non  
è fisicamente consegnabile  
tramite il Bond (che ha taglio  
minimo EUR 0.01) ed è perciò  
consegnata in cash per un  
valore pari a **EUR 0.00** ( $0.0555$   
 $\times 0.01 \times 44.1116\%$ )



Valore di mercato del rimborso finale **EUR 860.29 (+ cedola  
garantita, pari a 7.50 EUR al mese)**