

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)**