

Report dei prodotti del 08.03.2019

8.80% p.a. Multi Barrier Reverse Convertible su Adidas, Coca-Cola, McDonalds, VISA

Osservazione continua della barriera | Rimborso anticipato a discrezione | Quanto CHF

Scadenza 23.09.2019; emissione in CHF; Non quotato

ISIN CH0366636014 | Numero di valore 36663601

I presupposti di questo documento sono basati su dati e modelli considerati affidabili e precisi. Ciononostante l'emittente ed il lead manager non garantiscono né si fanno carichi di alcuna rimostranza riguardo alla completezza o correttezza di tali assunzioni.

DETTAGLI DEL PRODOTTO

Dati Emissione

| | |
|----------------------------|--|
| Data di emissione | 02.07.2018 |
| Prezzo di emissione | 100.00% |
| Volume di emissione | CHF 10'000'000 (con possibilità d'aumento) |

Informazioni generali

| | |
|---|--|
| Numero di valore | 36663601 |
| ISIN | CH0366636014 |
| Data di rimborso | 02.10.2019 (soggetta a modifiche in caso di irregolarità nel settlement) |
| Valore nominale | CHF 1'000 |
| Moneta di rimborso | CHF |
| Copertura del Cambio | Quanto CHF |
| Convenzione conteggio del giorno di cedola | 30/360; non aggiustato; interesse maturato durante ogni periodo cedolare (data iniziale inclusa e data finale esclusa) |

Quotazione

Tipologia di quotazione Non quotato
 I prezzi dei mercati secondari sono quotati come «dirty»; l'importo degli interessi maturati è incluso nei prezzi.

Metodologia di quotazione

I prezzi dei mercati secondari sono quotati in percentuale.

Ai fini del sistema fiscale svizzero, la cedola è suddivisa in due componenti:

| | |
|--------------------------------|------------|
| Componente d'interessi | 0.00% p.a. |
| Componente di premio d'opzione | 8.80% p.a. |

Aspettativa di mercato dell'investitore

I prezzi dei sottostanti evolvono lateralmente rispetto al loro fixing iniziale o leggermente al rialzo. Il barrier event non si verificherà.

Descrizione del prodotto

Questo prodotto offre all'investitore una cedola, a prescindere dalla performance del valore sottostante durante la vita del prodotto, con una protezione condizionale dal ribasso. Se un barrier event non si verifica, l'investitore riceverà il valore nominale alla data di rimborso. Nel caso invece che ciò si sia verificato ma tutti i valori sottostanti chiudono in scadenza ad un livello superiore rispetto al fixing iniziale, l'investitore otterrà comunque un pagamento in contanti pari al valore nominale alla data di rimborso. In alternativa, il rimborso del prodotto dipende dal valore del sottostante con il rendimento peggiore, come descritto nella sezione "Rimborso".

L'emittente ha diritto al rimborso anticipato, secondo le disposizioni nel articolo "rimborso anticipato".

Importo della/e cedola/e e data/e di pagamento delle cedole

| Data di pagamento della cedola | Importo della cedola | L'importo della cedola maturata |
|--------------------------------|----------------------|---------------------------------|
| 14.09.2018 | CHF 22.00 | PAGATO |
| 14.12.2018 | CHF 22.00 | PAGATO |
| 14.03.2019 | CHF 22.00 | CHF |
| 14.06.2019 | CHF 22.00 | CHF |
| 02.10.2019 | CHF 22.00 | CHF |

* i livelli sono espressi in percentuale del Fixing iniziale

** verrà determinato alla scadenza

| | | | | | | |
|---|--|---------------------------------|---------------------------------------|------------------------------------|-------------------------------|---|
| Sottoscrizione 11.06.2018 21.06.2018 | Monitoraggio della barriera 21.06.2018 23.09.2019 | Barriera Adidas (69.00%) | Barriera Coca-Cola (69.00%) | Barriera McDonalds (69.00%) | Barriera VISA (69.00%) | Giorno di monitoraggio 11.12.2018 |
| Giorno di monitoraggio 11.03.2019 | Giorno di monitoraggio 11.06.2019 | Scadenza 23.09.2019 | Data di rimborso 02.10.2019 | | | |

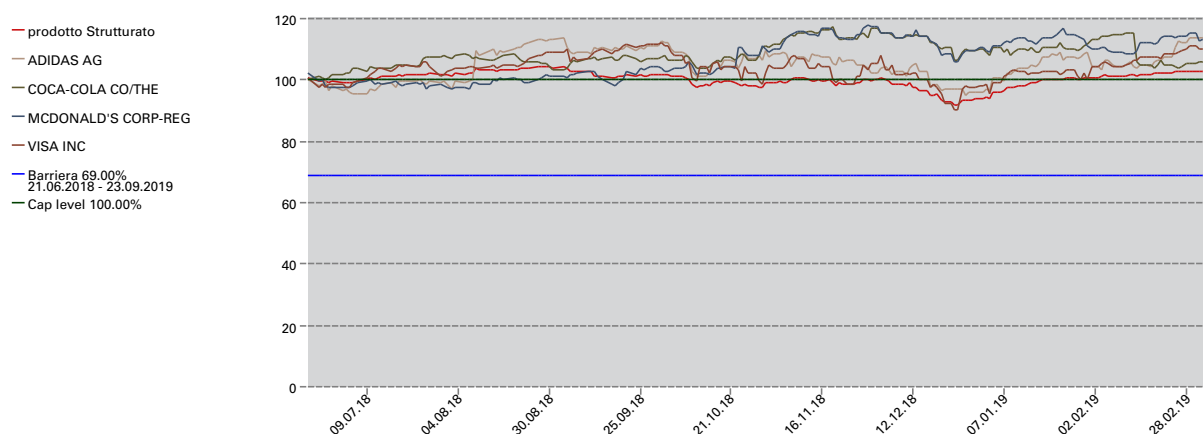
SOTTOSTANTI

| Sottostante | Borsa di riferimento | Bloomberg Ticker | Fixing iniziale (100%)* | Barriera (69.00%)* | Strike level (100.00%)* | Rapporto di conversione |
|---------------------|----------------------|------------------|-------------------------|--------------------|-------------------------|-------------------------|
| ADIDAS AG | Xetra | ADS GY | EUR 190.15 | EUR 131.20 | EUR 190.15 | TBA** |
| COCA-COLA CO/THE | NYSE | KO UN | USD 43.09 | USD 29.73 | USD 43.09 | TBA** |
| MCDONALD'S CORP-REG | NYSE | MCD UN | USD 160.53 | USD 110.77 | USD 160.53 | TBA** |
| VISA INC | NYSE | V UN | USD 134.53 | USD 92.83 | USD 134.53 | TBA** |

PERFORMANCE

| | Ultimo prezzo | Questa settimana | Questo Mese | Quest'anno | Dall'inizio | Distanza dalla barriera | Probabilità di toccare la barriera |
|-----------------------------|----------------|------------------|--------------|--------------|--------------|-------------------------|------------------------------------|
| prodotto Strutturato | 103.04% | 0.10% | 0.24% | 9.64% | 3.04% | | |
| ADIDAS AG | EUR 210.60 | -2.45% | -1.40% | 15.46% | 10.75% | 37.70% | < 1% |
| COCA-COLA CO/THE | USD 44.84 | -1.19% | -1.10% | -5.30% | 4.06% | 33.70% | < 1% |
| MCDONALD'S CORP-REG | USD 179.50 | -3.00% | -2.36% | 1.09% | 11.82% | 38.29% | < 1% |
| VISA INC | USD 147.35 | -1.42% | -0.52% | 11.68% | 9.53% | 37.00% | < 1% |

Performance nel tempo



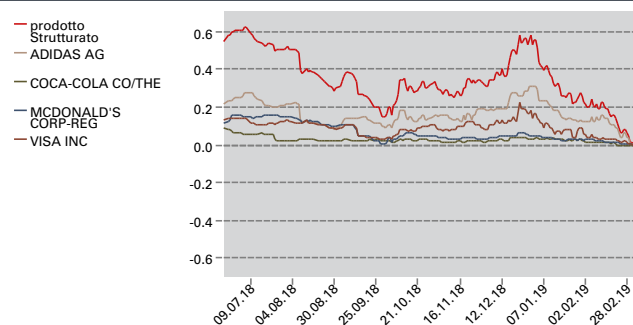
SENSIBILITÀ

prodotto Strutturato

Delta
0.00

| | |
|---------------------|------|
| ADIDAS AG | 0.00 |
| COCA-COLA CO/THE | 0.00 |
| MCDONALD'S CORP-REG | 0.00 |
| VISA INC | 0.00 |

Il Delta è il coefficiente che indica la sensibilità del prezzo di uno strumento derivato rispetto alle variazioni del prezzo del sottostante. Uno Delta di 0.1 significa che una variazione del prezzo del sottostante dell'1% implica una variazione del prezzo del prodotto Strutturato del 0.1%.

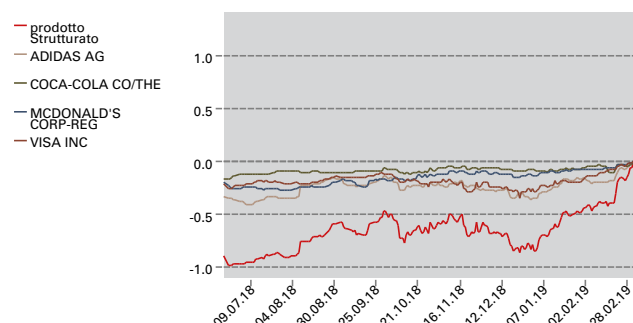


prodotto Strutturato

Vega
0.00

| | |
|---------------------|------|
| ADIDAS AG | 0.00 |
| COCA-COLA CO/THE | 0.00 |
| MCDONALD'S CORP-REG | 0.00 |
| VISA INC | 0.00 |

Vega è il coefficiente che indica la sensibilità del prezzo di uno strumento derivato rispetto alle variazioni della volatilità implicita del sottostante. Uno Vega del sottostante di 0.1 significa che una variazione del prezzo del sottostante dell'1% implica una variazione del prezzo del prodotto Strutturato del 0.1%.



DOCUMENTAZIONE DEL PRODOTTO

Il termsheet indicativo adempie i requisiti di un prospetto semplificato unicamente informativo a norma dell'articolo 5 della Legge federale svizzera sugli investimenti collettivi di capitale (LICoI). Il termsheet, che sarà disponibile al più tardi alla data di emissione come anche il "termsheet finale", adempie i requisiti di un prospetto semplificato definitivo ai sensi dell'articolo 5 della Legge sugli investimenti collettivi (LICoI). Il termsheet contiene un sommario delle informazioni sul prodotto e ha un fine unicamente informativo. **Il termsheet finale ed il Programma di emissione e offerta del relativo emittente valido alla data del fixing iniziale, che comprende tutte le ulteriori condizioni ("Programma"), sono giuridicamente**

vincolanti e costituiscono le uniche fonti di documentazione del prodotto ("Product Documentation"); se ne raccomanda quindi sempre la lettura accurata. I termini utilizzati nel termsheet finale, ma ivi non definiti, assumono significato in funzione del contenuto del "Programma". **Sebbene traduzioni in altre lingue possano essere disponibili, solo il final termsheet ed il Programm in inglese sono legalmente vincolanti.**

Si prega di fare riferimento alla termsheet per qualsiasi chiarimento riferito ai rischi connessi a questo prodotto.

Qualora questa pubblicazione contenga informazioni relative ad un prodotto d'investimento al dettaglio e assicurativo preassemblato (PRIIP), un document contenente le informazioni chiave (Key Information Document), come richiesto dal Regolamento (UE) n. 1286/2014 (il Regolamento PRIIPs), è disponibile e può essere ottenuto sul sito www.priipkidportal.com.

Per tutta la durata del prodotto, è possibile ordinare gratuitamente la documentazione ad esso relativa dal lead manager al seguente indirizzo: Europaallee 39, 8004 Zurigo (Svizzera), oppure via telefono (+41-(0)58-800 1000*), fax (+41-(0)58-800 1010) oppure via e-mail (termsheet@leonteq.com). Le ricordiamo che tutte le conversazioni su una linea contressegnata da un asterisco (*) vengono registrate. Qualora Lei ci contattasse mediante tale numero, riterremo questa prassi come implicitamente accettata.

PER LA DISTRIBUZIONE IN SVIZZERA

Leonteq Securities AG

Europaallee 39
8004 Zurich, Switzerland
Tel: +41 58 800 1111
termsheet@leonteq.com
www.leonteq.com

PER LA DISTRIBUZIONE NELLO SPAZIO ECONOMICO EUROPEO (SEE)

Leonteq Securities (Europe) GmbH

Goetheplatz 2
60311 Frankfurt, Germania
Tel: +49 69 970 979 900
www.leonteq.de

SUCCURSALI

Leonteq Securities (Europe) GmbH

Paris Branch
40 Rue la Pérouse
75116 Paris, Francia
Tel: +33 (0)1 40 62 79 38
www.leonteq.fr

Leonteq Securities (Europe) GmbH

London Branch
108 Cannon Street
London EC4N 6EU, United Kingdom
Phone: +44 (0)207 467 5350
www.leonteq.co.uk