

Rapport du produit en date du 18.06.2019

11.30% p.a. Multi Barrier Reverse Convertible sur Bayer, Illumina, Lonza

Observation continue de la barrière pour chacun des sous-jacents | Remboursement par anticipation au gré de l'émetteur | Quanto CHF

Date de constatation finale 15.06.2020; émis en CHF; Non coté

ISIN CH0461383553 | Numéro de valeur 46138355

Les hypothèses mentionnées ici sont fondées sur des données et des modèles que nous considérons fiables et corrects. Cependant l'émetteur et le gestionnaire ne font nullement valoir ni ne garantissent l'exactitude et/ou l'exhaustivité de ces hypothèses.

DÉTAILS DU PRODUIT

Données de l'émission

Date d'émission 22.03.2019
Prix d'émission 100.00%
Taille d'émission CHF 10'000'000 (peut être augmentée à tout moment)

Informations générales

Numéro de valeur 46138355
ISIN CH0461383553
Date de remboursement 22.06.2020 (sous réserve des dispositions en cas de perturbation du paiement)
Valeur nominale CHF 1'000
Devise de paiement CHF
Protection de la devise Quanto CHF
Méthode de calcul des intérêts 30/360; non ajusté; intérêts courus pendant chaque période de coupon (date de début incluse et date de fin exclue)

Cotation/bourse

Non coté

Mode de cotation

Les prix du marché secondaire sont cotés dirty, c'est-à-dire que les intérêts courus sont inclus dans les prix.

Type de cotation

Les cours du marché secondaire sont cotés en pourcentage.

Le coupon est la somme de deux composantes aux fins de la fiscalité suisse:

Composante d'intérêts 0.00% p.a.

Composante liée à la prime de l'option 11.30% p.a.

Anticipation de marché de l'Investisseur

Les sous-jacents se négocient à un cours stable ou légèrement en hausse.

L'évènement de barrière n'aura pas lieu.

Description du produit

Ce produit offre aux investisseurs un coupon quelle que soit la performance des produits sous-jacent, pendant toute la période, associé à une protection conditionnelle à la baisse. Si un évènement de barrière n'A PAS eu lieu, l'investisseur recevra la valeur nominale à la date de remboursement. Si un évènement de barrière a eu lieu mais que tous les sous-jacents terminent à la date de constatation final au-dessus de leur niveau de constatation initial, l'investisseur recevra à la date de remboursement, un paiement équivalent à la valeur nominale. Dans les autres cas, le remboursement du produit à échéance dépendra de la valeur du sous-jacent avec la plus mauvaise performance, comme décrit dans la section «Remboursement».

L'émetteur a droit au remboursement anticipé, selon les conditions décrites dans la section «Remboursement anticipé».

Montant(s) du coupon et date(s) de paiement du coupon

Date de paiement du coupon	Montant du coupon	Intérêt intérimaire (le montant couru du coupon)
20.06.2019	CHF 28.25	CHF
19.09.2019	CHF 28.25	CHF
19.12.2019	CHF 28.25	CHF
19.03.2020	CHF 28.25	CHF
22.06.2020	CHF 28.25	CHF

* les niveaux sont exprimés en pourcentage du Niveau de constatation initial

** sera déterminé à la date de constatation final

Souscription 08.03.2019 - 15.03.2019	Observation de la barrière 15.03.2019 - 15.06.2020	Barrière Bayer (55.00%)	Barrière Illumina (55.00%)	Barrière Lonza (55.00%)	Date d'Observation 16.09.2019	Date d'Observation 16.12.2019
Date d'Observation 16.03.2020	Date de constatation finale 15.06.2020	Date de remboursement 22.06.2020				

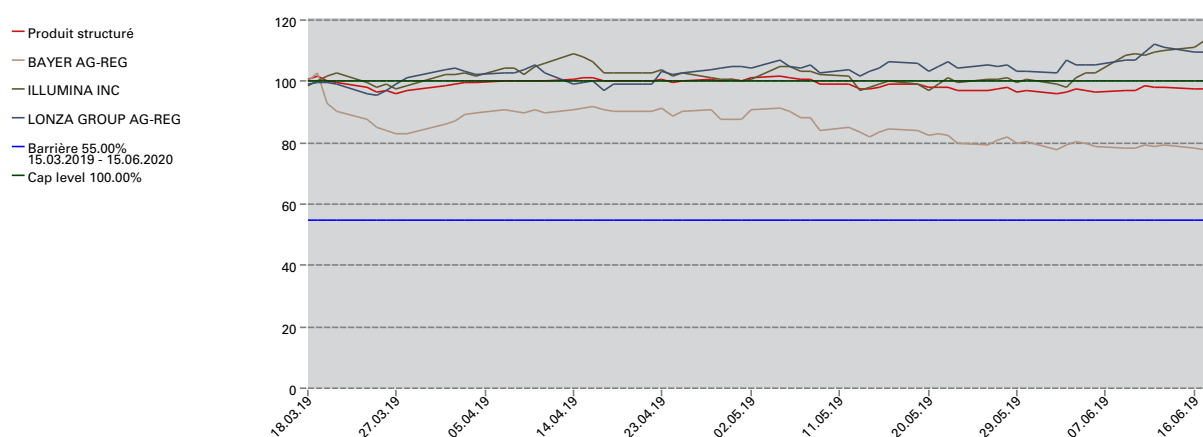
SOUS-JACENTS

Sous-jacent	Bourse de référence	Ticker Bloomberg	Niveau de constatation initial (100%)*	Barrière (55.00%)*	Prix d'exercice (100.00%)*	Rapport de conversion (Taux de Conversion)
BAYER AG-REG	Xetra	BAYN GY	EUR 67.75	EUR 37.26	EUR 67.75	TBA**
ILLUMINA INC	NASDAQ	ILMN UQ	USD 309.84	USD 170.41	USD 309.84	TBA**
LONZA GROUP AG-REG	SIX Swiss Exchange AG	LONN SW	CHF 300.00	CHF 165.00	CHF 300.00	3.3333

PERFORMANCE

	Dernier prix	Depuis le début de la semaine	Depuis le début du mois	Depuis le début de l'année	Depuis l'origine	Distance à la barrière	Probabilité d'une barrière touchée
Produit structuré	96.17%	-1.61%	-1.05%	-3.83%	-3.83%		25%
BAYER AG-REG	EUR 54.07	2.31%	-0.42%	-20.19%	-20.19%	31.09%	22%
ILLUMINA INC	USD 347.85	1.12%	11.78%	12.27%	12.27%	51.01%	7%
LONZA GROUP AG-REG	CHF 335.00	1.79%	8.06%	11.67%	11.67%	50.75%	4%

Performance au cours du temps



SENSIBILITÉ

	Delta
Produit structuré	0.50
BAYER AG-REG	0.43
ILLUMINA INC	0.05
LONZA GROUP AG-REG	0.02

Le Delta mesure la sensibilité du prix de l'option par rapport à la variation d'un actif sous-jacent auquel elle est associée. Si le Delta du sous-jacent est égal à 0.1, cela signifie que 1% de variation du prix du sous-jacent induit une variation de 0.1% du prix de l'option.

	Vega
Produit structuré	-0.81
BAYER AG-REG	-0.58
ILLUMINA INC	-0.16
LONZA GROUP AG-REG	-0.07

Le Vega mesure la sensibilité du prix de l'option par rapport à la volatilité implicite d'un actif sous-jacent auquel elle est associée. Si le Vega du sous-jacent est égal à 0.1, cela signifie que 1% de variation de la volatilité implicite du sous-jacent induit une variation de 0.1% du prix de l'option.

DOCUMENTATION DU PRODUIT

La termsheet indicative comprend les informations nécessaires à un prospectus préliminaire simplifié conformément à l'article 5 de la Loi fédérale suisse sur les Placements Collectifs de Capitaux (« LPCC »). La termsheet qui sera disponible au plus tard à la date d'émission, ainsi que la termsheet finale (« Final Termsheet ») comprennent les informations nécessaires à un prospectus simplifié définitif conformément à l'article 5 de la LPCC. La termsheet contient un résumé d'informations sélectionnées en rapport avec le produit et a un but exclusivement informatif. **Seuls la termsheet finale (« Final Termsheet ») et le programme d'émission et d'offre de l'émetteur correspondant valable à la date de constatation initiale et**

contenant toutes les conditions dans sa dernière version (le «Programme») forment la documentation complète et juridiquement contraignante relative au produit (la «documentation du produit»). Ainsi, la termsheet finale («Final Termsheet») doit toujours être lue avec le Programme. Les termes utilisés dans la termsheet finale («Final Termsheet»), mais qui n'y sont pas définis, ont le sens qui leur est donné dans le Programme. **Bien que des traductions dans d'autres langues puissent être disponibles, seuls la termsheet finale et le programme en anglais sont juridiquement rattachés.**

Veillez vous référer à la termsheet liée au programme pour tout risque associé à ce produit.

Dans la mesure où cette publication contient des informations relatives à un produit d'investissement packagés de détail et fondés sur l'assurance (PRIIP), un document d'information clé conforme au règlement (UE) n°1286/2014 (réglementation PRIIPs) est disponible et peut être obtenu à l'adresse suivante : www.priipkidportal.com

La documentation relative au produit peut être commandée gratuitement pendant toute la durée de vie du produit auprès du gestionnaire, à l'adresse suivante: Europaallee 39, 8004 Zurich (Suisse), par téléphone (+41-(0)58-800 1000*), fax (+41-(0)58-800 1010) ou e-mail (termsheet@leonteq.com). Veuillez noter que tous les appels effectués vers les numéros marqués d'un astérisque (*) sont enregistrés. L'utilisation de ce numéro vaut accord de votre part quant à son enregistrement.

POUR LA DISTRIBUTION EN SUISSE

Leonteq Securities AG

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

POUR LA DISTRIBUTION DANS L'ESPACE ECONOMIQUE EUROPÉEN (EEE)

Leonteq Securities (Europe) GmbH

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

SUCCURSALES

Leonteq Securities (Europe) GmbH

Paris Branch
40 Rue la Pérouse
75116 Paris, France
Tél: +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