

# Basisinformationsblatt ("BIB")

## Zweck

Dieses Informationsblatt stellt dem Anleger wesentliche Informationen über dieses Anlageprodukt zur Verfügung. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um dem Anleger dabei zu helfen, die Art, das Risiko, die Kosten sowie die möglichen Wertgewinne und -verluste dieses Produkts zu verstehen, und dem Anleger dabei zu helfen, es mit anderen Produkten zu vergleichen.

## Produkt

### Kapitalschutzzertifikat in USD bezogen auf Spread USD SOFR 10Y - USD SOFR 2Y

Valorennummer: 126532413 | ISIN: CH1265324132 | WKN: A33EM7

Emittentin: **Leonteq Securities AG, Guernsey Branch, St. Peter Port, Guernsey**

PRIIP-Hersteller: **Leonteq Securities AG** | Der PRIIP-Hersteller gehört zur Leonteq Gruppe. | [www.leonteq.com](http://www.leonteq.com) | Weitere Informationen erhalten Sie telefonisch unter +41 58 800 1111 | Zuständige Behörde: Nicht anwendbar. Der PRIIP-Hersteller hat seinen Sitz in der Schweiz und unterliegt der prudentiellen Aufsicht durch die Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht („FINMA“). Die FINMA gilt nicht als zuständige Aufsichtsbehörde im Sinne der EU-Verordnung 1286/2014 über Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte (PRIIP). | Datum der Erstellung des Basisinformationsblatts: 13.05.2024

Der Investor ist im Begriff, ein Produkt zu erwerben, das nicht einfach ist und schwer zu verstehen sein kann.

#### 1. Um welche Art von Produkt handelt es sich?

##### Gattung

Bei diesem Produkt handelt es sich um ein Schweizer Wertrecht, das dem Schweizer Recht unterliegt.

##### Laufzeit

Die Laufzeit des Produkts endet am Rückzahlungstag, sofern das Produkt nicht vorzeitig gekündigt wird.

##### Ziele

Ziel dieses Produkts ist es, dem Anleger einen bestimmten Anspruch zu vorab festgelegten Bedingungen zu gewähren. Das Produkt hat eine feste Laufzeit und wird am Rückzahlungstag zurückbezahlt. Die Möglichkeiten für die Rückzahlungen sehen wie folgt aus:

- der Anleger ist berechtigt, von der Emittentin am Rückzahlungstag für jedes Produkt eine Barzahlung in der Abwicklungswährung in der Höhe des Kapitalschutzbetrages zu erhalten.

Der Anleger kann einen Verlust erleiden, falls die Barabwicklung am Rückzahlungstag unter dem Kaufpreis des Produkts liegt. Anders als bei einer Direktinvestition in den Basiswert verzichtet der Anleger auf den Anspruch auf Dividenden aus dem Basiswert und hat keine weiteren Ansprüche aus dem Basiswert (z. B. Stimmrechte).

<b>Produktwährung (Auszahlungswährung)</b>	US-Dollars ("USD")	<b>Minimaler Anlagebetrag / Kleinste Handelsmenge</b>	USD 100.00
<b>Ausgabebetrag</b>	05.05.2023	<b>Fixierung</b>	28.04.2023
<b>Letzter Handelstag /-Zeit</b>	28.04.2033 / Börsenschluss	<b>Erster Börsenhandelstag</b>	05.05.2023
<b>Rückzahlungstag</b>	05.05.2033	<b>Verfall (Finaler Festlegungstag)</b>	28.04.2033
<b>Nennbetrag (Denomination)</b>	USD 100.00	<b>Ausgabepreis</b>	100.00%
<b>Abwicklungsart</b>	Barabwicklung	<b>Börse</b>	Frankfurt Stock Exchange; gehandelt an Open Market – Börse Frankfurt Zertifikate
<b>Fixing Page</b>	Bloomberg Seite: USISSO10 Index (11.00 AM NY). Sollte kein solcher Level auf der entsprechenden Seite verfügbar sein, wird der zuletzt publizierte Level zur Anwendung kommen, festgelegt durch die Berechnungsstelle.  Bloomberg Seite: USISSO02 Index (11.00 AM NY). Sollte kein solcher Level auf der entsprechenden Seite verfügbar sein, wird der zuletzt publizierte Level zur Anwendung kommen, festgelegt durch die Berechnungsstelle.	<b>Coupon Berechnung</b>	Denomination × Hebel × MAX(0; Fixierungslevel <sub>i</sub> - Ausübungspreis) × Day Count Fraction <sub>i</sub>
<b>Hebel</b>	4.50	<b>Day Count Fraction<sub>i</sub></b>	Entspricht dem Jahresanteil für die entsprechende Berechnungsperiode <sub>i</sub> , für welche der Couponsatz <sub>i</sub> berechnet wird, wie von der Berechnungsstelle festgestellt sowie in Übereinstimmung mit der Coupon Zinsberechnungsmethode.
<b>Zinsberechnungsmethode</b>	30/360	<b>Fixierungslevel<sub>i</sub></b>	Spread Strategie am Coupon Beobachtungstag gemäss der entsprechenden Fixierungsseite, festgelegt durch die Berechnungsstelle.

#### i Berechnungsperiode (einschließlich Startdatum) - Berechnungsperiode (ohne Enddatum) • Couponbeobachtungstag • Coupon Zahlungstag

1 28.04.2023 - 28.07.2023 • 25.04.2023 • 04.08.2023 2 28.07.2023 - 30.10.2023 • 25.07.2023 • 06.11.2023 3 30.10.2023 - 29.01.2024 • 25.10.2023 • 05.02.2024 4 29.01.2024 - 29.04.2024 • 25.01.2024 • 06.05.2024 5 29.04.2024 - 29.07.2024 • 25.04.2024 • 05.08.2024 6 29.07.2024 - 28.10.2024 • 25.07.2024 • 04.11.2024 7 28.10.2024 - 28.01.2025 • 25.10.2024 • 04.02.2025 8 28.01.2025 - 28.04.2025 • 27.01.2025 • 05.05.2025 9 28.04.2025 - 28.07.2025 • 25.04.2025 • 04.08.2025 10 28.07.2025 - 28.10.2025 • 25.07.2025 • 04.11.2025 11 28.10.2025 - 28.01.2026 • 27.10.2025 • 04.02.2026 12 28.01.2026 - 28.04.2026 • 26.01.2026 • 05.05.2026 13 28.04.2026 - 28.07.2026 • 27.04.2026 • 04.08.2026 14 28.07.2026 - 28.10.2026 • 27.07.2026 • 04.11.2026 15 28.10.2026 - 28.01.2027 • 26.10.2026 • 04.02.2027 16 28.01.2027 - 28.04.2027 • 25.01.2027 • 05.05.2027 17 28.04.2027 - 28.07.2027 • 26.04.2027 • 04.08.2027 18 28.07.2027 - 28.10.2027 • 26.07.2027 • 04.11.2027 19 28.10.2027 - 28.01.2028 • 25.10.2027 • 04.02.2028 20 28.01.2028 - 28.04.2028 • 25.01.2028 • 05.05.2028 21 28.04.2028 - 28.07.2028 • 25.04.2028 • 04.08.2028 22 28.07.2028 - 30.10.2028 • 25.07.2028 • 06.11.2028 23 30.10.2028 - 29.01.2029 • 25.10.2028 • 05.02.2029 24 29.01.2029 - 30.04.2029 • 25.01.2029 • 07.05.2029 25 30.04.2029 - 30.07.2029 • 25.04.2029 • 06.08.2029 26 30.07.2029 - 29.10.2029 • 25.07.2029 • 05.11.2029 27 29.10.2029 - 28.01.2030 • 25.10.2029 • 04.02.2030 28 28.01.2030 - 29.04.2030 • 25.01.2030 • 06.05.2030 29 29.04.2030 - 29.07.2030 • 25.04.2030 • 05.08.2030 30 29.07.2030 - 28.10.2030 • 25.07.2030 • 04.11.2030 31 28.10.2030 - 28.01.2031 • 25.10.2030 • 04.02.2031 32 28.01.2031 - 28.04.2031 • 27.01.2031 • 05.05.2031 33 28.04.2031 - 28.07.2031 • 25.04.2031 • 04.08.2031 34 28.07.2031 - 28.10.2031 • 25.07.2031 • 04.11.2031 35 28.10.2031 - 28.01.2032 • 27.10.2031 • 04.02.2032 36 28.01.2032 - 28.04.2032 • 26.01.2032 • 05.05.2032 37 28.04.2032 - 28.07.2032 • 26.04.2032 • 04.08.2032 38 28.07.2032 - 28.10.2032 • 26.07.2032 • 04.11.2032 39 28.10.2032 - 28.01.2033 • 25.10.2032 • 04.02.2033 40 28.01.2033 - 28.04.2033 • 25.01.2033 • 05.05.2033\*

\*der letzte Coupon Zahlungstag entspricht dem Rückzahlungsdatum

Gattung	Spread Strategie	Spread Anfangslevel	Ausübungspreis
Zinssatz	USD SOFR 10Y - USD SOFR 2Y	-0.8790%	0.0000%

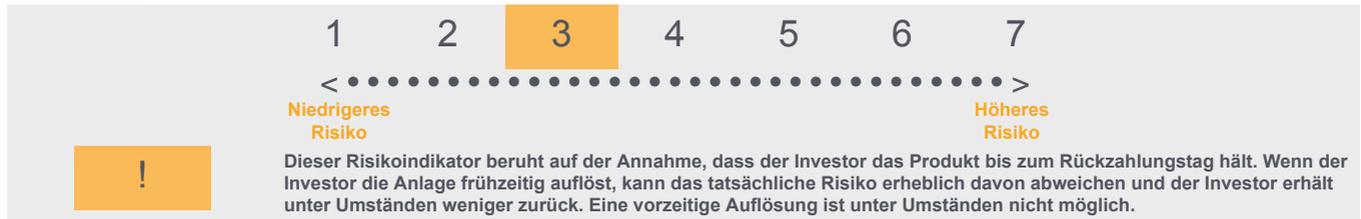
Die Produktbedingungen sehen vor, dass bei Eintreten bestimmter aussergewöhnlicher Ereignisse (1) Anpassungen des Produkts stattfinden können und/oder (2) die Emittentin das Produkt vorzeitig kündigen kann. Diese Ereignisse werden in den Produktbedingungen näher erläutert und betreffen vorrangig den Basiswert bzw. die Basiswerte, das Produkt und die Emittentin des Produkts. Zu diesen aussergewöhnlichen Ereignissen gehören unter anderem die Einstellung eines Basiswerts, Steuerereignisse und der Wegfall der Möglichkeit für die Emittentin, die erforderlichen Absicherungsgeschäfte zu tätigen. Im Fall der Kündigung kann der Rückzahlungsbetrag deutlich unter dem Kaufpreis liegen. Selbst ein Totalverlust der Investition ist möglich. Der Anleger trägt zudem das Risiko, dass das Produkt zu einem für ihn unvorteilhaften Zeitpunkt gekündigt wird und dass der Anleger den Rückzahlungsbetrag nur zu schlechteren Konditionen wiederanlegen kann.

#### Kleinanleger-Zielgruppe

- Das Produkt richtet sich an Privatkunden, die das Ziel der Vermögensbildung verfolgen und einen langfristigen Anlagehorizont haben.
- Der Investor kann Verluste bis zu einem Totalverlust des Anlagebetrags tragen und legt keinen Wert auf Produkte mit Kapitalschutz.
- KENNTNISSE & ERFAHRUNG: Anleger, die folgende Eigenschaften aufweisen: Grundkenntnisse der betreffenden Finanzinstrumente (der Anleger kann Anlageentscheidungen auf der Grundlage der gesetzlichen Unterlagen oder der Basisinformationen der Vertriebsstelle treffen); keine Erfahrung an Finanzmärkten

## 2. Welche Risiken bestehen und was könnte der Investor im Gegenzug dafür bekommen?

#### Risikoindikator



Der Gesamtrisikoindikator hilft dem Investor, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass der Investor bei diesem Produkt Geld verlieren kann, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder die Emittentin nicht in der Lage ist, den Investor auszubehalten.

Die Emittentin hat dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 3 eingestuft, was einer mittelniedrigen Risikoklasse entspricht.

Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als mittelniedrig eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen ist es unwahrscheinlich, dass die Fähigkeit der Emittentin beeinträchtigt wird, den Investor auszuführen.

**Der Anleger soll das Währungsrisiko beachten. Sofern der Anleger Zahlungen in einer anderen Währung erhält, wird die endgültige Rendite, die der Anleger erhält, vom Wechselkurs zwischen den beiden Währungen abhängen. Dieses Risiko ist bei dem oben angegebenen Indikator nicht berücksichtigt.**

Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor künftigen Marktentwicklungen, sodass der Investor das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren könnte.

Wenn die Emittentin dem Investor nicht das zahlen kann, was dem Investor zusteht, könnte der Investor das gesamte angelegte Kapital verlieren.

Detaillierte Informationen zu sämtlichen Risiken finden Sie in den Risikoabschnitten der rechtlichen Dokumentation, wie nachfolgend im Abschnitt „Sonstige zweckdienliche Angaben“ angegeben.

#### Performance-Szenarien

Was der Anleger bei diesem Produkt am Ende herausbekommt, hängt von der künftigen Marktentwicklung ab. Die künftige Marktentwicklung ist ungewiss und lässt sich nicht mit Bestimmtheit vorhersagen. Die dargestellten Szenarien beruhen auf Ergebnissen aus der Vergangenheit und bestimmten Annahmen. Die Märkte könnten sich künftig völlig anders entwickeln.

Empfohlene Haltedauer:	05.05.2033	
Anlagebeispiel:	USD 10'000	
Szenarien	Bei einem Ausstieg des Anlegers nach 1 Jahr	Bei einem Ausstieg des Anlegers nach 05.05.2033
<b>Minimum</b>	Es gibt keine garantierte Mindestrendite. Der Anleger könnte einen Teil seines investierten Kapitals oder auch sein gesamtes investiertes Kapital verlieren.	
<b>Stressszenario</b>	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten könnte USD 8700	USD 11760
	Jährliche Durchschnittsrendite -12.96%	1.82%
<b>Pessimistisches Szenario</b>	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten könnte USD 10150	USD 11760
	Jährliche Durchschnittsrendite 1.54%	1.82%
<b>Mittleres Szenario</b>	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten könnte USD 10630	USD 13230
	Jährliche Durchschnittsrendite 6.31%	3.16%
<b>Optimistisches Szenario</b>	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten könnte USD 12520	USD 22670
	Jährliche Durchschnittsrendite 25.23%	9.54%

In den angeführten Zahlen sind sämtliche Kosten des Produkts selbst enthalten, jedoch unter Umständen nicht alle Kosten, die der Anleger an seinen Berater oder seine Vertriebsstelle zahlen muss. Bei den angeführten Zahlen ist die persönliche steuerliche Situation des Anlegers nicht berücksichtigt, die sich ebenfalls darauf auswirken kann, wie viel der Anleger zurückerhält.

Das Stressszenario zeigt, was der Anleger unter extremen Marktbedingungen zurückbekommen könnte.

Die aufgeführten Szenarien stellen mögliche Ergebnisse dar, die auf Grundlage von Simulationen berechnet wurden.

## 3. Was geschieht, wenn die Emittentin nicht in der Lage ist, die Auszahlung vorzunehmen?

Der Anleger ist dem Risiko ausgesetzt, dass die Emittentin ihre Verpflichtungen aus dem Produkt nicht erfüllen kann, beispielsweise im Falle einer Insolvenz (Zahlungsunfähigkeit / Überschuldung). Ein Totalverlust des eingesetzten Kapitals ist möglich. Das Produkt unterliegt als Schuldverschreibung keiner Einlagensicherung.

## 4. Welche Kosten entstehen?

Die Person, die den Anleger zum Produkt berät oder dem Anleger das Produkt verkauft, kann dem Anleger sonstige Kosten berechnen. Sollte dies der Fall sein, teilt diese Person dem Anleger diese Kosten mit und legt dar, wie sich diese Kosten auf die Anlage des Anlegers auswirken werden.

#### Kosten im Zeitverlauf

In den Tabellen werden die Beträge dargestellt, die zur Deckung verschiedener Kostenarten der Anlage des Anlegers entnommen werden. Diese Beträge hängen davon ab, wie viel der Anleger anlegt, wie lange er das Produkt hält und wie gut sich das Produkt entwickelt. Die hier dargestellten Beträge veranschaulichen einen beispielhaften Anlagebetrag und verschiedene mögliche Anlagezeiträume.

Wir haben folgende Annahme zugrunde gelegt:

- Im ersten Jahr würde der Anleger den angelegten Betrag zurückerhalten (0% Jahresrendite). Für die anderen Halteperioden haben wir angenommen, dass sich das Produkt wie im mittleren Szenario dargestellt entwickelt.
- eine Investition von USD 10'000

	Bei einem Ausstieg des Anlegers nach 1 Jahr	Bei einem Ausstieg des Anlegers nach der empfohlenen Haltedauer
Gesamtkosten	USD 295	USD 148
Jährliche Auswirkungen der Kosten (*)	3.0%	0.2% pro Jahr

(\*) Diese Angaben veranschaulichen, wie die Kosten die Rendite des Anlegers pro Jahr während der Haltedauer verringern. Wenn der Anleger beispielsweise zum Ende der empfohlenen Haltedauer aussteigt, wird die durchschnittliche Rendite des Anlegers pro Jahr voraussichtlich 3.3% vor Kosten und 3.2% nach Kosten betragen. Wir können einen Teil der Kosten zwischen uns und der Person aufteilen, die dem Anleger das Produkt verkauft, um die für den Anleger erbrachten Dienstleistungen zu decken. Diese Person teilt dem Anleger den Betrag mit.

#### Zusammensetzung der Kosten

Einmalige Kosten bei Einstieg oder Ausstieg	Bei einem Ausstieg des Anlegers nach 1 Jahr
Einstiegskosten	Bis zu USD 148
Ausstiegskosten	USD 148

#### 5. Wie lange sollte der Investor die Anlage halten und kann der Investor vorzeitig Geld entnehmen?

##### Empfohlene Haltedauer: 05.05.2033 (bis zum Rückzahlungstag)

Zweck dieses Produktes ist es, dem Investor das oben unter Sektion "1. Um welche Art von Produkt handelt es sich?" beschriebene Rückzahlungsprofil zu bieten. Die Möglichkeit vom positiven Rückzahlungsprofil zu profitieren besteht nur, wenn der Investor das Produkt bis zum Verfall hält.

Es gibt keine anderen Möglichkeiten für den Investor, sein Geld vorzeitig zu entnehmen, als das Produkt über die Börse, an der das Produkt notiert ist, oder ausserbörslich zu verkaufen.

Unter normalen Marktbedingungen hängt der Preis, zu dem der Anleger das Produkt verkaufen kann, von den zum jeweiligen Zeitpunkt vorherrschenden Marktparametern ab, wodurch der investierte Betrag einem Risiko ausgesetzt sein könnte.

In aussergewöhnlichen Marktsituationen oder bei technischen Störungen kann ein Erwerb bzw. Verkauf des Produkts vorübergehend erschwert oder nicht möglich sein.

#### 6. Wie kann sich der Investor beschweren?

Beschwerden über die Person, die zu dem Produkt berät oder es verkauft, können über die relevante Internetseite direkt an diese Person gerichtet werden.

Beschwerden über das Produkt oder über das Verhalten des Emittenten des Produkts können in Textform an die folgende Adresse übermittelt werden: Leonteq Securities AG, Europaallee 39, 8004 Zürich, Schweiz, [kid@leonteq.com](mailto:kid@leonteq.com), [www.leonteq.com](http://www.leonteq.com).

#### 7. Sonstige zweckdienliche Angaben

Zusätzliche Dokumente in Bezug auf das Produkt und insbesondere die Final Terms oder das Pricing Supplement und das Emissions- und Angebotsprogramm (inklusive etwaiger Nachträge), werden auf der Internetseite [www.leonteq.com](http://www.leonteq.com) veröffentlicht. Um weitere ausführlichere Informationen zu erhalten, insbesondere zur Struktur und zu den mit einer Anlage in das Produkt verbundenen Risiken, sollten Sie diese Dokumente lesen. Ausserdem hat Leonteq Securities AG das BIB auf Basis bestimmter Annahmen erstellt, die das Unternehmen nach eigenem Ermessen von Zeit zu Zeit neu bewerten und anpassen wird. Bei der Berechnung der ausgewiesenen Kennzahlen und Performanceszenarien hat der PRIIP-Hersteller zudem einen gewissen Ermessensspielraum walten lassen.

Das Produkt wird nicht als nachhaltig eingestuft. Es wird keine Zusicherung bezüglich der Nachhaltigkeit – im Sinne von Verordnung (EU) 2020/852 (Taxonomie-Verordnung) und Verordnung (EU) 2019/2088 (Offenlegungsverordnung) oder einem anderen nachhaltigkeitsbezogenen Gesetz oder einer Regulierung – des Produktes oder eines Basiswertes abgegeben. Eine Bezugnahme auf nachhaltigkeitsbezogene Begriffe im Zusammenhang mit dem Produkt oder einem Basiswert stellt keine Abgabe einer solchen Zusicherung durch die Emittentin, den Lead Manager bzw. die Garantin, sofern vorhanden, dar. Weiterhin wird festgelegt, dass sich das Produkt nicht an Kunden mit besonderen Anforderungen hinsichtlich der Nachhaltigkeitspräferenzen gemäss Art. 2 Nr. 7 der MiFID II – Delegierte Verordnung (EU) 2017/565 richtet.