

Basisinformationsblatt ("KID")

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

Open-end Tracker-Zertifikat in CHF bezogen auf Ethereum

Valorennummer: 114329857 | ISIN: CH1143298573 | SIX-Symbol: SETHTQ

Emittentin: **Leonteq Securities AG, Zürich, Schweiz (Emittentin)**

PRIIP-Hersteller: **Leonteq Securities AG** | Der PRIIP-Hersteller gehört zur Leonteq Gruppe. | www.leonteq.com | Weitere Informationen erhalten Sie telefonisch unter +41 58 800 1111 | Zuständige Behörde: Nicht anwendbar | Datum der Erstellung des Basisinformationsblatts: 19.01.2023

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

Das Produkt hat keine feste Laufzeit und wird nach der Ausübung durch den Anleger oder der Beendigung durch die Emittentin zurückgezahlt.

Ziele

Ziel dieses Produkts ist es, Ihnen einen bestimmten Anspruch zu vorab festgelegten Bedingungen zu gewähren. Das Produkt zeichnet sich dadurch aus, dass es dem Anleger ermöglicht, an einer Wertentwicklung des Basiswerts zu partizipieren und ist daher in Bezug auf das Risiko vergleichbar mit einer Direktinvestition in den Basiswert. Die Laufzeit des Produkts ist nicht fixiert. Das Produkt kann vorzeitig durch den Anleger eingelöst oder durch die Emittentin am festgelegten Kündigungstermin gekündigt werden. Am finalen Rückzahlungstag erhält der Anleger eine Barauszahlung in der Auszahlungswährung. Die Möglichkeit für die Rückzahlung sieht wie folgt aus:

Am Rückzahlungstag erhält der Anleger einen Barausgleich (der „Rückzahlungsbetrag“) in der Auszahlungswährung. Der Barausgleich entspricht dem Produkt aus (i) dem Finalen Festlegungslevel multipliziert mit (ii) dem Umrechnungsverhältnis und (iii) dem FX-Wechselkurs abzüglich der Verwaltungsgebühr (zeitanteilig gezahlt). Die Verwaltungsgebühr mindert in Abhängigkeit von der Haltedauer den Rückzahlungsbetrag und beeinflusst den Sekundärmarktpreis negativ.

Jeder Anleger hat jährlich das Recht, durch eine Ankündigung (die „Rückzahlungsankündigung“) die Produkte zur Rücknahme auszuüben („Anleger-Rückzahlung“). Die Emittentin kann alle Produkte mit sofortiger Wirkung unter Einhaltung einer Frist von fünf Geschäftstagen durch Bekanntmachung der Ausübung ihres Kündigungsrechts (die „Rückzahlungsbekanntmachung“) und Angabe des Rückzahlungstags kündigen („Emittentin-Rückzahlung“).

Der Anleger kann einen Verlust erleiden, falls der Barausgleich am Rückzahlungstag unter dem Kaufpreis des Produkts liegt. Anders als bei einer Direktinvestition in den Basiswert profitiert der Anleger nicht von Ansprüchen aus dem Basiswert.

Produktwährung (Auszahlungswährung)	Schweizer Franken ("CHF")	Minimaler Anlagebetrag / Kleinste Handelsmenge	1 Zertifikat(e)
Ausgabebetrag	29.10.2021	Fixierung	22.10.2021
Ausübungsverhältnis	0.01	Basiswert	Ethereum
Letzter Handelstag /-Zeit	Open-end	Bloomberg Ticker	XETUSD
Erster Börsenhandelstag	29.10.2021	Referenzquelle**	Bitstamp Limited
Rückzahlungstag	5. Arbeitstag nach dem Finalen Festlegungstag (vorbehaltlich von Abwicklungsstörungen)	Anfangslevel	USD 4'000.00
Verfall (Finaler Festlegungstag)	Im Falle von 1) einer vorzeitigen Kündigung durch die Emittentin gemäss den Angaben in der Kündigungsmitteilung durch die Emittentin oder 2) einer Kündigung durch den Anleger, für diesen spezifischen Anleger der 5. Arbeitstag nachdem die vollständige und unterzeichnete Kündigung bei der Zahlstelle eingetroffen ist.	Ausgabepreis	CHF 36.62
Administrationsgebühr (AG)	1.50% p.a. (wird pro rata temporis abgezogen) Die Verwaltungsgebühr mindert in Abhängigkeit von der Haltedauer den Rückzahlungsbetrag und beeinflusst den Sekundärmarktpreis negativ.	Anfangslevel	Ein beobachteter Preis oder eine Kombination aus beobachteten Preisen (volumengewichtet), der/die bei Fixierung an der/den Referenzquelle(n) festgestellt wird/werden, angepasst um Gebühren oder Kosten, insbesondere Handelsprovisionen, die der Emittentin (oder einer Absicherungsgesellschaft von ihr) für den Aufbau einer Absicherungsposition im Basiswert belastet.
Endlevel (Finaler Schlusskurs)	Ein beobachteter Preis oder eine Kombination aus beobachteten Preisen (volumengewichtet), der/die bei Verfall an der/den Referenzquelle(n) für den Basiswert, bereinigt um Gebühren oder Kosten, insbesondere Handelsprovisionen, die der Emittentin (oder einer Absicherungsgesellschaft von ihr) belastet werden, und Gewinne und Verluste aus der Beendigung einer Absicherungsposition im Basiswert (einschliesslich, aber nicht beschränkt auf, jedwede durch die Emittentin realisierte Verluste aus Betrug, Diebstahl und Cyber-Attacken bezogen auf Dienstleister und/oder Referenzquelle(n) der Emittentin welche direkt den Basiswert betreffen).	Abwicklungsart	Barabwicklung
Börse	SIX Swiss Exchange	Währungsrisiko	Wenn der Basiswert in einer anderen Währung notiert als das Produkt, wird dieser anhand des

Währungsumrechnungskurses in die Wahrung des Produkts umgerechnet.

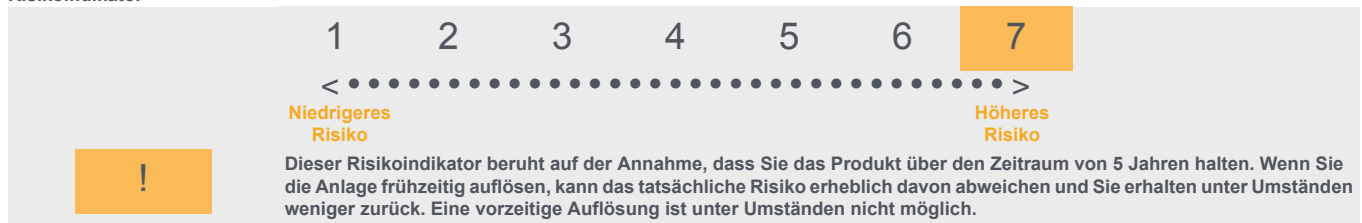
Die Produktbedingungen sehen vor, dass bei Eintreten bestimmter aussergewohnlicher Ereignisse (1) Anpassungen des Produkts stattfinden konnen und/oder (2) die Emittentin das Produkt vorzeitig kundigen kann. Diese Ereignisse werden in den Produktbedingungen naher erlautert und betreffen vorrangig den Basiswert bzw. die Basiswerte, das Produkt und die Emittentin des Produkts. Zu diesen aussergewohnlichen Ereignissen gehoren unter anderem die Einstellung eines Basiswerts, Steuerereignisse und der Wegfall der Moglichkeit fur die Emittentin, die erforderlichen Absicherungsgeschafte zu tatigen. Im Fall der Kundigung kann der Ruckzahlungsbetrag deutlich unter dem Kaufpreis liegen. Selbst ein Totalverlust der Investition ist moglich. Der Anleger tragt zudem das Risiko, dass das Produkt zu einem fur ihn unvorteilhaften Zeitpunkt gekundigt wird und dass der Anleger den Ruckzahlungsbetrag nur zu schlechteren Konditionen wiederanlegen kann.

Kleinanleger-Zielgruppe

- Das Produkt richtet sich an Privatkunden, die das Ziel der Vermogensbildung 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.
- KENNNTNISSE & 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 Finanzmarkten

2. Welche Risiken bestehen und was konnte der Investor im Gegenzug dafur bekommen?

Risikoindikator



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

Die Emittentin hat dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 7 eingestuft, was der hochsten Risikoklasse entspricht.

Das Risiko potenzieller Verluste aus der kunftigen Wertentwicklung wird als sehr hoch eingestuft. Bei ungunstigen Marktbedingungen ist es unwahrscheinlich, dass die Fahigkeit der Emittentin beeintrachtigt wird, den Investor ausbezahlen zu konnen.

Der Anleger soll das Wahrungsrisiko beachten. Sofern der Anleger Zahlungen in einer anderen Wahrung erhalt, wird die endgultige Rendite, die der Anleger erhalt, vom Wechselkurs zwischen den beiden Wahrungen abhangen. Dieses Risiko ist bei dem oben angegebenen Indikator nicht berucksichtigt.

Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor kunftigen Marktentwicklungen, sodass der Investor das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren konnte.

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

Detaillierte Informationen zu samtlichen 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, hangt von der kunftigen Marktentwicklung ab. Die kunftige Marktentwicklung ist ungewiss und lasst sich nicht mit Bestimmtheit vorhersagen. Die dargestellten Szenarien beruhen auf Ergebnissen aus der Vergangenheit und bestimmten Annahmen. Die Markte konnten sich kunftig vollig anders entwickeln.

Empfohlene Haltedauer:	5 Jahre	
Anlagebeispiel:	CHF 10.000	
Szenarien	Bei einem Ausstieg des Anlegers nach 1 Jahr	Bei einem Ausstieg des Anlegers nach 5 Jahren (Empfohlene Haltedauer)
Minimum	Es gibt keine garantierte Mindestrendite. Der Anleger konnte einen Teil seines investierten Kapitals oder auch sein gesamtes investiertes Kapital verlieren.	
Stressszenario	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten konnte CHF 0	CHF 0
	Jahrliche Durchschnittsrendite -100.00%	-100.00%
Pessimistisches Szenario	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten konnte CHF 1700	CHF 0
	Jahrliche Durchschnittsrendite -83.01%	-100.00%
Mittleres Szenario	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten konnte CHF 7870	CHF 700
	Jahrliche Durchschnittsrendite -21.31%	-41.18%
Optimistisches Szenario	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten konnte CHF 28650	CHF 14900
	Jahrliche Durchschnittsrendite 186.49%	8.30%

In den angefuhrten Zahlen sind samtliche Kosten des Produkts selbst enthalten, jedoch unter Umstanden nicht alle Kosten, die der Anleger an seinen Berater oder seine Vertriebsstelle zahlen muss. Bei den angefuhrten Zahlen ist die personliche steuerliche Situation des Anlegers nicht berucksichtigt, die sich ebenfalls darauf auswirken kann, wie viel der Anleger zuruckerhalt.

Das Stressszenario zeigt, was der Anleger unter extremen Marktbedingungen zuruckbekommen konnte.

Die aufgefuhrten Szenarien stellen mogliche 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 erfullen kann, beispielsweise im Falle einer Insolvenz (Zahlungsunfahigkeit / uberschuldung). Ein Totalverlust des eingesetzten Kapitals ist moglich. Das Produkt unterliegt als Schuldverschreibung keiner Einlagensicherung.

4. Welche Kosten entstehen?

Die Person, die den Anleger zum Produkt berat 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 Betrage dargestellt, die zur Deckung verschiedener Kostenarten der Anlage des Anlegers entnommen werden. Diese Betrage hangen davon ab, wie viel der Anleger anlegt, wie lange er das Produkt halt und wie gut sich das Produkt entwickelt. Die hier dargestellten Betrage veranschaulichen einen beispielhaften Anlagebetrag und verschiedene mogliche Anlagezeitraume.

Wir haben folgende Annahme zugrunde gelegt:

- Im ersten Jahr wurde der Anleger den angelegten Betrag zuruckerhalten (0 % Jahresrendite). Fur die anderen Halteperioden haben wir angenommen, dass sich das Produkt wie im mittleren Szenario dargestellt entwickelt.
- CHF eine Investition von 10.000

	Bei einem Ausstieg des Anlegers nach 1 Jahr	Bei einem Ausstieg des Anlegers nach 5 Jahren (Empfohlene Haltedauer)
Gesamtkosten	CHF 350	CHF 306
Jährliche Auswirkungen der Kosten (*)	3.5%	3.2% 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 -38.0 % vor Kosten und -41.2 % 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	1.0% des Betrags, den der Anleger beim Einstieg in diese Anlage zahlt. Diese Kosten sind bereits im Preis enthalten, den der Anleger zahlt.	Bis zu CHF 101
Ausstiegskosten	Die Ausstiegskosten betragen voraussichtlich 1.0 % der Investition bevor diese an den Anleger ausgezahlt wird. Diese Kosten sind bereits im Preis enthalten, den der Anleger erhält, und fallen nur an, wenn der Anleger vor Fälligkeit aussteigt. Wenn der Anleger das Produkt bis zur Fälligkeit hält, fallen keine Ausstiegskosten an.	CHF 101
Laufende Kosten pro Jahr		
Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten	1.5% des Werts der Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung auf Grundlage der tatsächlichen Kosten des letzten Jahres.	CHF 150
Transaktionskosten	Nicht anwendbar	
Zusätzliche Kosten unter bestimmten Bedingungen		
Erfolgsgebühr	Für dieses Produkt gibt es keine Erfolgsgebühr.	

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

Empfohlene Haltedauer: 5 Jahre

Der durchschnittliche Investor hält diese Produktart für durchschnittlich ungefähr 5 Jahre. Zudem erhöht diese Periode die Vergleichbarkeit mit anderen Anlageprodukten ohne fixe Laufzeit. Der Investor hat die Möglichkeit, das Produkt gemäss den oben unter Sektion "1. Um welche Art von Produkt handelt es sich?" beschriebenen Rückzahlungsbedingungen vorzeitig zu kündigen. Weiter 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, 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 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 KID 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.