

## Basisinformationsblatt ("KID")

### Zweck

Dieses Informationsblatt stellt dem Investor (im Folgenden auch "dem Anleger", "Ihnen") wesentliche Informationen über dieses Anlageprodukt zur Verfügung. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um dem Investor dabei zu helfen, die Art, das Risiko, die Kosten sowie die möglichen Gewinne und Verluste dieses Produkts zu verstehen, und dem Investor dabei zu helfen, es mit anderen Produkten zu vergleichen.

## 1.25% p.a. Reverse Convertible in EUR bezogen auf Caterpillar

Valorennummer: 50316483 | ISIN: CH0503164839 | WKN: A2UR6S

Emittentin: **Leonteq Securities AG, Guernsey Branch, St. Peter Port, Guernsey** | [www.leonteq.com](http://www.leonteq.com) | Weitere Informationen erhalten Sie telefonisch unter +41 58 800 1111

PRIP-Hersteller: **Leonteq Securities AG** | Zuständige Behörde: Nicht anwendbar | Erstellungsdatum des KIDs: 27.05.2020

**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.

#### Ziele

Ziel dieses Produkts ist es, dem Anleger einen bestimmten Anspruch zu vorab festgelegten Bedingungen zu gewähren. Dieses Produkt bietet dem Investor einen Zinsbetrag unabhängig von der Entwicklung des Basiswerts während der Laufzeit des Produkts. Das Produkt hat eine feste Laufzeit und wird am Vorzeitigen Rückzahlungstag oder am Rückzahlungstag zurückbezahlt.

#### Vorzeitige Rückzahlung am entsprechenden Vorzeitigen Rückzahlungstag:

Sofern an einem der vordefinierten Autocall Beobachtungstagen der offizielle Schlusskurs des Basiswerts über seinem Autocall Trigger Level liegt, wird eine vorzeitige Rückzahlung stattfinden und das Produkt verfällt mit sofortiger Wirkung.

Der Investor bekommt EUR 1'000.00 (100% der Denomination) zuzüglich der Zinszahlung, sofern anwendbar, für den entsprechenden Zinszahlungstag. Es erfolgen keine weiteren Zahlungen.

#### Rückzahlungsmöglichkeiten am finalen Rückzahlungstag

- Sofern der Endlevel auf oder unter dem Ausübungspreis liegt, erhält der Anleger eine Anzahl (entspricht dem Ausübungsverhältnis) an Basiswerten pro Produkt geliefert. Allfällige Fraktionen pro Produkt werden basierend auf dem Endlevel ausbezahlt. Fraktionen des Basiswertes werden nicht kumuliert.
- Sofern der Endlevel über dem Ausübungspreis liegt, erhält der Anleger EUR 1'000.00 (100% der Denomination).

Der Anleger könnte einen Verlust erleiden, wenn die Summe des Wertes der gelieferten Aktien am Rückzahlungsdatum, der Fraktionen des Basiswertes und der Couponzahlung unter dem Kaufpreis des Produkts liegt. Anders als bei einer Direktinvestition in die Basiswerte erhält der Anleger keine Dividendenausschüttung oder einen anderen Anspruch, der aus den Basiswerten resultiert (z. B. Stimmrechte). Der Anleger wird nicht von einem Ansteigen des Marktpreises des Basiswerts über dem Ausübungspreis profitieren.

<b>Produktwährung (Auszahlungswährung)</b>	Euro ("EUR")	<b>Minimaler Anlagebetrag / Kleinste Handelsmenge</b>	EUR 1'000.00
<b>Ausgabebetrag</b>	29.10.2019	<b>Fixierung</b>	22.10.2019
<b>Letzter Handelstag /-Zeit</b>	22.10.2024 / Börsenschluss	<b>Erster Börsenhandelstag</b>	29.10.2019
<b>Rückzahlungsdatum</b>	29.10.2024	<b>Verfall (Finaler Festlegungstag)</b>	22.10.2024
<b>Nennbetrag (Denomination)</b>	EUR 1'000.00	<b>Ausgabepreis</b>	100.00%
<b>Anfangslevel</b>	<b>Eröffnungskurs:</b> Der offizielle Eröffnungskurs des Basiswertes am bei Fixierung an der Referenzbörse: Caterpillar	<b>Endlevel (Finaler Schlusskurs)</b>	Offizieller Schlusskurs des Basiswerts am Finalen Festlegungstag, wie von der Referenzbörse berechnet und publiziert.
<b>Zinsbetrag</b>	1.25% p.a. der Denomination	<b>Abwicklungsart</b>	Barabwicklung oder Lieferung des Basiswertes
<b>Börse</b>	Börse Frankfurt Zertifikate AG (Open Market)	<b>Preisangabe unter Berücksichtigung der aufgelaufenen Zinsen</b>	ja (Dirty Prices); der Anleger bezahlt keine zusätzlichen, aufgelaufene Zinsen, wenn er das Produkt erwirbt.
<b>Währungsrisiko</b>	Das Produkt ist bei Verfall währungsbesichert, d. h. dass, obwohl das Anfangslevel in der Basiswertwährung festgelegt wird, die in der Basiswertwährung festgelegten Beträge 1:1 in die Produktwährung umgerechnet werden (Quanto).	<b>Wechselkurs</b>	Der Währungskurs, welcher für die Umrechnung der Währung des betreffenden Basiswertes in die Auszahlungswährung benutzt wird, abgebildet auf der Bloomberg Seite "BFIK" bei Verfall um 10.00 Uhr Lokalzeit in New York bzw. für Basiswerte mit Referenzbörse in der Region Asien-Pazifik um 16.00 Uhr Lokalzeit in Hongkong.

Zinszahlungstag	Zinsbetrag	Autocall Beobachtungstag	Autocall Trigger Level <sup>a</sup>	Vorzeitige Rückzahlungstag
29.10.2020	EUR 12.50	22.10.2020	100.00%	29.10.2020
29.10.2021	EUR 12.50	22.10.2021	100.00%	29.10.2021
31.10.2022	EUR 12.50	24.10.2022	100.00%	31.10.2022
30.10.2023	EUR 12.50	23.10.2023	100.00%	30.10.2023
29.10.2024	EUR 12.50	-	-	-

<sup>a</sup>: die Werte sind in Prozent des Anfangskurses (bzw. des Anfangslevels) ausgedrückt.

Basiswert	Gattung	Referenzbörse	Bloomberg Ticker	ISIN
CATERPILLAR INC	Aktien	NYSE	CAT UN	US1491231015

Basiswert	Anfangslevel (100%)*	Ausübungspreis (50.00%)*	Autocall Trigger Level (100.00%)*	Ausübungsverhältnis (Conversion Ratio)
CATERPILLAR INC	USD 132.59	USD 66.30	USD 132.59	TBA**

\*Levels sind in Prozent des Anfangslevels ausgedrückt

\*\* wird bei Verfall festgelegt und entspricht dem Ausgabepreis dividiert durch den Strike Level, welcher als absoluter Wert in der Währung des Basiswertes ausgedrückt wird, konvertiert, falls notwendig, in die Auszahlungswährung unter Berücksichtigung des Wechselkurses.

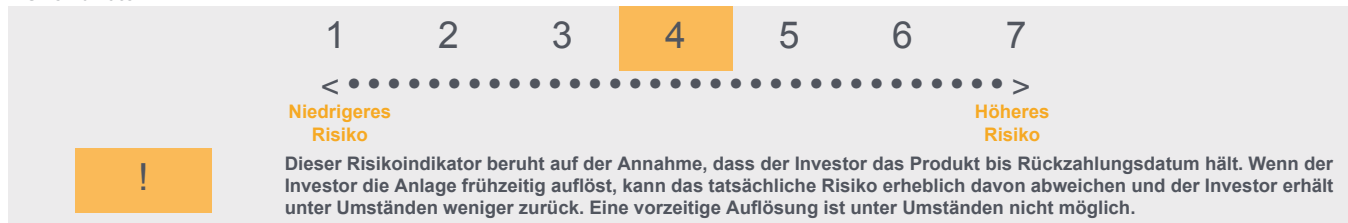
Im Falle eines außerordentlichen Ereignisses kann die Emittentin die Produkte mit sofortiger Wirkung kündigen. Beispiele für außerordentliche Ereignisse sind unter anderem der Verlust des Basiswerts, Steuerereignisse und der Wegfall der Möglichkeit für den Emittenten, die erforderlichen Absicherungsgeschäfte zu tätigen. In diesem Fall kann der Rückzahlungsbetrag deutlich unter dem Kaufpreis des Produkts liegen. Sogar ein Totalverlust des gesamten Anlagebetrags ist möglich. Der Investor trägt zudem das Risiko, dass die Produkte zu einem für ihn unvorteilhaften Zeitpunkt vorzeitig gekündigt werden und dass der Investor den Rückzahlungsbetrag nur zu schlechteren Konditionen wiederanlegen kann.

#### Kleinanleger-Zielgruppe

- Das Produkt richtet sich an Privatkunden, die das Ziel der Vermögensbildung verfolgen und einen mittelfristigen Anlagehorizont haben.
- Der Investor kann Verluste bis zu einem Totalverlust des Anlagebetrags tragen und legt keinen Wert auf Produkte mit Kapitalschutz.
- KENNTNISSE UND ERFAHRUNG: Anleger, die mindestens eine der nachstehenden Eigenschaften aufweisen: Einige Kenntnisse der betreffenden Finanzinstrumente oder mäßige 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 auszubahlen.

Die Emittentin hat dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 4 eingestuft, was einer mittleren Risikoklasse entspricht.

Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als mittel eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen kann es sein, dass die Fähigkeit der Emittentin beeinträchtigt wird, den Investor auszusahlen.

**Der Investor soll das Währungsrisiko beachten. Der Investor könnte Zahlungen in einer anderen Währung erhalten, sodass seine endgültige Rendite vom Wechselkurs zwischen den beiden Währungen abhängen wird. 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.

Im Falle einer physischen Lieferung können auch nach dem Verfallsdatum bis zum Tag, wo der Basiswert im Depot des Anlegers eingebucht ist, Kursverluste anfallen. 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

Anlage von EUR 10,000		1 Jahr	3 Jahre	29.10.2024 (Empfohlene Haltedauer)
Stressszenario	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten könnte	EUR 1845.38	EUR 6831.55	EUR 4381.79
	Jährliche Durchschnittsrendite	-81.55%	-11.91%	-17.00%
Ungünstiges Szenario	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten könnte	EUR 9693.62	EUR 9240.35	EUR 7635.26
	Jährliche Durchschnittsrendite	-3.06%	-2.59%	-5.91%
Neutrales Szenario	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten könnte	EUR 10614.69	EUR 10654.93	EUR 10657.93
	Jährliche Durchschnittsrendite	6.15%	2.13%	1.45%
Günstiges Szenario	Was der Investor nach Abzug der Kosten erhalten könnte	EUR 10635.27	EUR 10883.36	EUR 11159.55
	Jährliche Durchschnittsrendite	6.35%	2.86%	2.51%

Diese Tabelle zeigt, wie viel der Investor über die nächsten Jahre und am Rückzahlungstag unter verschiedenen Szenarien zurückerhalten könnte, wenn der Investor EUR 10.000,00 anlegt.

Die dargestellten Szenarien zeigen, wie sich die Anlage des Investors entwickeln könnte. Der Investor kann sie mit den Szenarien für andere Produkte vergleichen. Die dargestellten Szenarien entsprechen einer Schätzung der künftigen Wertentwicklung aufgrund früherer Wertveränderungen dieses Investments; sie sind kein exakter Indikator. Wie viel der Investor tatsächlich erhalten wird, hängt davon ab, wie sich der Markt entwickelt und wie lange der Investor die Anlage/das Produkt halten wird.

Das Stressszenario zeigt, was der Investor im Fall extremer Marktbedingungen zurückerhalten könnte und berücksichtigt nicht den Fall, dass wir womöglich nicht in der Lage sind, die Auszahlung vorzunehmen.

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

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

Der Anleger ist dem Risiko ausgesetzt, dass der Emittent seine 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. Dieses Produkt ist nach den Bestimmungen des TCM Security Agreement for Triparty Collateral Management Secured Structured Products besichert (das "TCM-besicherte strukturierte Produkt"). Das Verlustrisiko des Anlegers aufgrund des Ausfalls der Emittentin und gegebenenfalls der Garantin ist durch die Pfandbesicherung lediglich vermindert. Einzelheiten zur Besicherung sind im Basisprospekt aufgeführt.

## 4. Welche Kosten entstehen?

#### Kosten im Zeitverlauf

Die Renditeminderung (Reduction in Yield – RIY) zeigt, wie sich die vom Investor gezahlten Gesamtkosten auf die Anlagerendite, die der Investor erhalten könnte, auswirken. In den Gesamtkosten sind einmalige, laufende und zusätzliche Kosten berücksichtigt.

Die hier ausgewiesenen Beträge entsprechen den kumulierten Kosten des Produkts. Sie beinhalten etwaige Vertragsstrafen bei vorzeitigem Ausstieg. Bei den angegebenen Zahlen wird davon ausgegangen, dass der Investor EUR 10.000 anlegt. Die Zahlen sind Schätzungen und können in der Zukunft anders ausfallen.

Die Person, die dem Investor dieses Produkt verkauft oder ihn dazu berät, kann weitere Kosten in Rechnung stellen. Sollte dies der Fall sein, informiert die Person den Investor über diese Kosten und zeigt dem Investor auf, wie sich sämtliche Kosten im Zeitverlauf auf die Anlage des Investors auswirken werden.

Anlage von EUR 10,000	Falls der Investor das Produkt nach 1 Jahr einlöst	Falls der Investor das Produkt nach 3 Jahren einlöst	Falls der Investor das Produkt am Ende der empfohlenen Haltedauer einlöst
Gesamtkosten	EUR 40.31	EUR 78.43	EUR 40.47
Renditeminderung pro Jahr	0.40%	0.25%	0.09%

#### Zusammensetzung der Kosten

Aus der nachfolgenden Tabelle geht hervor:

- wie sich die verschiedenen Arten von Kosten jedes Jahr auf die Anlagerendite auswirken, die der Anleger am Ende der empfohlenen Haltedauer erhalten könnte.
- Zusammensetzung der Kosten.

#### Diese Tabelle zeigt die Auswirkungen auf die Rendite pro Jahr

Einmalige Kosten	Einstiegskosten	0.09%	Auswirkung der im Preis bereits inbegriffenen Kosten.
	Ausstiegskosten	-	Nicht anwendbar
Laufende Kosten	Portfoliotransaktionskosten	-	Nicht anwendbar
	Sonstige laufende Kosten	-	Nicht anwendbar
Zusätzliche Kosten	Erfolgsgebühr	-	Nicht anwendbar
	Carried Interests	-	Nicht anwendbar

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

##### Empfohlene Haltedauer: 29.10.2024 (bis zum Rückzahlungsdatum)

Zweck dieses Produktes ist es, dem Investor das oben unter Sektion "1. Um welche Art von Produkt handelt es sich?" beschriebene Rückzahlungsprofil zu bieten. 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.

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, insbesondere der vereinfachte Prospekt (simplified prospectus) und das Programm (inklusive etwaige 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 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 Leonteq zudem einen gewissen Ermessensspielraum walten lassen.