

# CREDIT LINKED CERTIFICATE SU BANCO BPM SENIOR

**Codice ISIN: IT0006762741**

- Tipologia: Credit Linked Certificate
- Capitale: Condizionatamente protetto
- Indicatore di Rischio: 4 su 7

## PUBBLICITÀ

State considerando di comprare un prodotto che non è semplice e può risultare di difficile comprensione.

La vendita di Certificati è destinata esclusivamente a investitori che abbiano una sufficiente o avanzata conoscenza in materia di investimenti e che siano in grado di comprendere le caratteristiche, i meccanismi di valutazione, i rischi e i costi connessi all'acquisto di tali strumenti. I Certificati sono strumenti finanziari complessi che possono presentare un elevato grado di rischio. Gli investitori sono soggetti al rischio di credito di Marex Financial (S&P: BBB). La presente pubblicazione è a carattere pubblicitario promozionale e non costituisce un prospetto ai sensi del Regolamento (EU) 2017/1129 e non può essere interpretato in tale modo. Il funzionamento del Certificato è descritto nelle Condizioni Definitive (Final Terms), nella Nota di Sintesi e nel KID, che devono essere letti congiuntamente con le informazioni contenute nel Prospetto di Base.

L'adempimento di pubblicazione del Prospetto di Base non comporta alcun giudizio della CONSOB o dell'altro ente regolatore sull'opportunità dell'investimento proposto e sul merito dei dati e delle notizie allo stesso relativi.

L'approvazione del Prospetto di Base non deve essere intesa come approvazione dei Certificati offerti o ammessi alla negoziazione in un mercato regolamentato.

# Credit Linked Certificate su Banco BPM Senior

## CARATTERISTICHE PRINCIPALI

- **Emittente:** Marex Financial (S&P: BBB)
- **Codice ISIN:** IT0006762741
- **Listing:** EuroTLX
- **Valuta:** EUR
- **Prezzo di emissione:** 10.000 EUR
- **Valore Nominale:** 10.000 EUR
- **Entità di Riferimento:** Banco BPM
- **Seniority:** Senior
- **Rating dell'Entità di Riferimento<sup>1</sup>:** S&P BBB- / Moody's Baa2
- **Data di fixing iniziale:** 27/03/2024
- **Data di emissione:** 03/04/2024
- **Data di Fixing Finale:** 20/12/2028
- **Data di scadenza:** 10/01/2029
- **Cedola:** 4.75% p.a.
- **Periodicità cedola:** Semi annuale
- **Frazione di Calcolo Giornaliera:** Actual/360

<sup>1</sup> Alla data di fixing iniziale. Potrebbe cambiare durante la vita del prodotto

## DESCRIZIONE

### Cedola Periodica

- Laddove non si sia verificato nessun Evento di Credito rispetto all'Entità di Riferimento, in ogni periodo, l'investitore riceve una Cedola calcolata come segue:  
*Valore Nominale x Cedola x Frazione di Calcolo Giornaliera*
- Qualora si sia verificato un Evento di Credito rispetto all'Entità di Riferimento, nessuna cedola verrà corrisposta, né verranno corrisposti ulteriori pagamenti delle cedole successive.

### Rimborso a Scadenza

- L'investitore riceve il Valore Nominale laddove non si sia verificato nessun Evento di Credito rispetto all'Entità di Riferimento.
- Qualora si sia verificato un Evento di Credito rispetto all'Entità di Riferimento, l'investitore subisce una perdita e riceverà il Valore Di Rimborso dell'Evento di Credito.

## CALENDARIO PRODOTTO

Periodo	Data Stacco Cedola	Data di Pagamento	Cedola
1	18 giugno 2024	20 giugno 2024	102,92 EUR
2	18 dicembre 2024	20 dicembre 2024	241,46 EUR
3	18 giugno 2025	20 giugno 2025	240,14 EUR
4	18 dicembre 2025	22 dicembre 2025	244,10 EUR
5	18 giugno 2026	22 giugno 2026	240,14 EUR
6	17 dicembre 2026	21 dicembre 2026	240,14 EUR
7	17 giugno 2027	21 giugno 2027	240,14 EUR
8	16 dicembre 2027	20 dicembre 2027	240,14 EUR
9	16 giugno 2028	20 giugno 2028	241,46 EUR
10	8 gennaio 2029	10 gennaio 2029	269,17 EUR

Gli investitori sono soggetti al rischio di credito di Marex Financial (S&P BBB), l'emittente del prodotto. I Certificati presentano un rischio in conto capitale a scadenza e durante la vita del prodotto.

Per conoscere tutte le caratteristiche del prodotto e comprendere tutti i rischi, gli investitori che considerano acquisto di un Certificato sono invitati a leggere attentamente il Prospetto di Base (in particolare, la sezione "Fattori di rischio"), le Condizioni Definitive, la Nota di Sintesi, il KID ed eventuali supplementi al Prospetto di Base al fine di comprendere i rischi associati ad un investimento nel prodotto. Tali documenti possono essere richiesti all'emittente e al distributore e sono comunque accessibili in formato elettronico tramite il sito web <https://certificati.marex.com/it/> a partire dal primo giorno della offerta pubblica. Tali documenti possono essere anche richiesti gratuitamente all'emittente via e-mail al seguente indirizzo: [sales@marex.com](mailto:sales@marex.com).

# Credit Linked Certificate su Banco BPM Senior

## INFORMAZIONI UTILI

- **Frazione di Calcolo Giornaliera** è il numero effettivo di giorni del Periodo della Cedola rispetto ai quali viene effettuato il pagamento, diviso per 360.
- **Periodo della Cedola** è definito come ciascun periodo compreso tra una Data di Pagamento della Cedola, inclusa, e la Data di Pagamento della Cedola applicabile, esclusa, a condizione che tale periodo iniziale abbia inizio e includa la Data di Emissione e termini, ma escluda, la prima Data di Pagamento della Cedola e l'ultimo di tali periodi terminerà ed escluderà la Data di Pagamento della Cedola finale. I Periodi della Cedola non saranno rettificati.
- **Valore Di Rimborso dell'Evento di Credito** è un importo che viene corrisposto all'investitore nel caso in cui si verifichi un Evento di Credito in relazione all'Entità di Riferimento, alla Data di Scadenza (o a una tale data successiva) dopo la determinazione del Tasso di Recupero. Il portatore subirà una perdita fino al 100% del Valore Nominale, in quanto riceverà solo il Tasso di Recupero x Valore Nominale (al netto di alcuni costi) come importo di rimborso, invece del 100% del Valore Nominale in assenza di un Evento di Credito).
- **Tasso di Recupero** è una percentuale, determinata in relazione a una o più obbligazioni dell'Entità di Riferimento, in una procedura d'asta organizzata dal CDDC (Credit Derivatives Determinations Committee ) dell'ISDA dopo la determinazione di un Evento di Credito (o, se l'asta non ha luogo, dall'Agente di Calcolo che cerca di ottenere quotazioni dai dealer per determinare il prezzo di specifiche obbligazioni dell'Entità di Riferimento che saranno utilizzate come tasso di recupero).
- **Evento di Credito** sarà determinato dal CDDC o da Marex Financial in qualità di Agente di Calcolo, a seguito del verificarsi di uno qualsiasi dei seguenti eventi:
  - Mancato Pagamento: l'Entità di Riferimento non effettua i pagamenti ai creditori dovuti per il suo debito in tutto o in tempo utile per un importo aggregato non inferiore al Requisito di Pagamento.
  - Fallimento: l'Entità di Riferimento va incontro a fallimento o liquidazione o insolvenza o altri eventi simili.
  - Ristrutturazione: il debito dell'Entità di Riferimento per un importo aggregato non inferiore al Requisito di Default viene ristrutturato a condizioni pregiudizievoli per il/i detentore/i del debito in questione in una forma vincolante per tutti i detentori.

### VANTAGGI

- Ricevere periodicamente una cedola fissa (in assenza di evento di credito)
- Protezione del capitale a scadenza in assenza di evento di credito
- Il rendimento è spesso più alto rispetto ad un'obbligazione emessa dall'Entità di Riferimento (con pari scadenza e seniority)

### SVANTAGGI

- L'investitore può registrare una perdita durante la vita del prodotto o a scadenza
- Investitore è esposto al rischio di credito dell'Entità di Riferimento
- Gli investitori sono soggetti al rischio di credito dell'emittente Marex Financial (S&P: BBB)

Questa presentazione è stata preparata da Marex Financial (compresa la divisione Marex Solutions) solo a scopo informativo e promozionale e rappresenta un documento a carattere pubblicitario.

Le informazioni contenute in questa presentazione non devono essere considerate come consigli, raccomandazioni o sollecitazioni all'acquisto o alla negoziazione in altro modo di titoli, investimenti o altri prodotti.

Il presente prodotto finanziario è un prodotto strutturato, e come tale, è un investimento complesso che implica dei rischi. E' compito del investitore procedere con una propria analisi delle caratteristiche e dei rischi legati alle operazioni, ai prodotti o alle transazioni menzionate in questo documento, facendo eventualmente ricorso ai suoi propri consulenti. Gli investitori sono, dunque, invitati a prendere autonomamente una decisione d'investimento dopo avere condotto la propria analisi in modo indipendente, tenuto conto dei propri bisogni specifici, e, se necessario, ricorrendo alla consulenza di professionisti (inclusi consulenti legali, fiscali, contabili) ritenuti utili. Le informazioni contenute nel presente documento non prendono in considerazione i bisogni specifici di determinate persone.

Questa presentazione può contenere dichiarazioni previsionali comprese dichiarazioni riguardanti le intenzioni, convinzioni o aspettative attuali di Marex Financial rispetto alle proprie attività e operazioni, alle condizioni di mercato, ai risultati delle operazioni, alla condizione finanziaria, all'adeguatezza patrimoniale, alle disposizioni specifiche e alle pratiche di gestione del rischio. Si avvisano i lettori di non fare indebito affidamento su queste dichiarazioni previsionali che possono essere soggette a modifiche senza preavviso. Sebbene sia stata utilizzata una ragionevole cura nella preparazione delle informazioni previsionali, i risultati effettivi possono variare in modo sostanzialmente positivo o negativo. Previsioni ed esempi ipotetici sono soggetti a incertezze e contingenze al di fuori del controllo di Marex Financial. La performance passata non è un'indicazione affidabile della performance futura.

Le informazioni contenute in questa presentazione sono aggiornate alla data di pubblicazione. Nessuna parte di questa presentazione può essere ridistribuita, copiata o riprodotta senza il previo consenso scritto di Marex Financial. Sebbene sia stata prestata ragionevole cura per garantire che i fatti dichiarati siano equi, chiari e non fuorvianti, Marex Financial non garantisce né rappresenta (espressamente o implicitamente) l'accuratezza, la completezza o l'idoneità allo scopo o all'uso di qualsiasi informazione in questa presentazione. Eventuali opinioni espresse possono essere soggette a modifiche senza preavviso. Marex Financial non si assume alcuna responsabilità per eventuali perdite o danni diretti, indiretti o consequenziali derivanti dall'uso di tutti o parte dei dati o delle informazioni in questa presentazione.

Questa presentazione è stata approvata da Marex Financial. Marex Financial è costituita ai sensi delle leggi dell'Inghilterra e del Galles (società n. 5613061, LEI n. 5493003EETVWYSIJ5A20 e partita IVA n. GB 872 8106 13) ed è autorizzata e regolamentata dalla Financial Conduct Authority (numero di registrazione FCA 442767). L'indirizzo registrato di Marex Financial è a 155 Bishopsgate, Londra, EC2M 3TQ.

Il gruppo di società Marex comprende, inter alia, Marex Financial, Marex Spectron International Limited, CSC Commodities UK Limited, Tangent Trading Limited, Marex Spectron Europe Limited, Marex North America LLC, Marex Capital Market Inc., Marex Spectron USA LLC, Spectron Energy Inc., Marex Australia Pty Ltd., Marex MENA Limited, Marex Hong Kong Limited, Marex Spectron Asia Pte. Ltd., Spectron Energy (Asia) Pte. Ltd., Marex France SAS (inclusa la divisione BIP AM), X-Change Financial Access, LLC, Starsupply Petroleum Europe B.V., Volcap Trading Partners Limited, Volcap Trading Partners France SAS, Arfinco S.A.

2023 Marex. Tutti i diritti riservati.