

## SCOPO

Il presente documento contiene informazioni chiave relative a questo prodotto d'investimento. Non si tratta di un documento promozionale. Le informazioni, prescritte per legge, hanno lo scopo di aiutarvi a capire le caratteristiche, i rischi, i costi, i guadagni e le perdite potenziali di questo prodotto e di aiutarvi a fare un raffronto con altri prodotti d'investimento.

## PRODOTTO

|  |   |
|--|---|
| <b>Nome del prodotto</b>                   | AUTOCALL YETI PHOENIX ON WO / BO MULTI NOTE   |
| <b>Codice Identificativo</b>               | ISIN Code: IT0006748799   |
| <b>Ideatore</b>                            | Natixis (Emittente: Natixis Structured Issuance/ Garante : Natixis)   |
| <b>Autorità Competente</b>                 | Autorité des Marchés Financiers e Autorité de Contrôle Prudentiel et de Résolution                                      |
| <b>Contatti</b>                            | <a href="http://www.natixis.com">www.natixis.com</a> / Per ulteriori informazioni chiamare il Numero: +33(1)58.55.47.00 |
| <b>Data di Realizzazione del documento</b> | 21 settembre 2021   |

State per acquistare un prodotto che non è semplice e può essere di difficile comprensione.

## COS'È QUESTO PRODOTTO?

**Tipo :** Il prodotto consiste in uno strumento di debito, governato dalla legge Inglese.

**Obiettivi :** Corrispondere il pagamento di interessi, a fronte del rischio di perdita del capitale. I valori riportati sotto si riferiscono all'Importo Nominale da voi investito.

- **Interessi (compreso l'Effetto Memoria):** se la Performance del Sottostante Peggior è superiore o uguale a -40%, a una Data di Valutazione Interessi, sarà corrisposto l'Importo di Interessi alla Data di Pagamento immediatamente successiva. Sarà inoltre corrisposto a tali date la somma di tutte le cedole non pagate per ciascuna data di Pagamento. Altrimenti, nessun Interesse sarà corrisposto a tale Data di Pagamento.
- **Evento Autocall:** se la Performance del Sottostante Peggior è superiore o uguale a 0% a una Data di Valutazione Autocall, il prodotto verrà rimborsato anticipatamente e, alla Data di Pagamento immediatamente successiva, verrà corrisposto l'Importo Nominale (oltre ad ogni interesse da pagare). Nessun pagamento aggiuntivo di capitale o interessi verrà corrisposto successivamente a tale pagamento e rimborso anticipato.
- **Importo di rimborso alla Data di Scadenza:**
  - Se il prodotto non viene rimborsato anticipatamente in seguito ad un Evento Autocall, allora sarà corrisposto uno degli importi indicati di seguito:
    - ◇ Se il Valore Finale Rettificato del Sottostante Peggior è maggiore o uguale a Valore di Esercizio, sarà rimborsato l'Importo Nominale.
    - ◇ Altrimenti, lei riceverà il Valore Finale Rettificato del Sottostante Peggior diviso per il Valore di Esercizio moltiplicato per il Valore Nominale. **La somma corrisposta in tale caso sarà inferiore al Valore Nominale e lei potrebbe perdere in parte o totalmente il suo capitale.**

### Date, valori e definizioni chiave

Tutte le date possono essere soggette a rettifiche dovute alla presenza di giorni non lavorativi ed eventi di turbativa del mercato.

- **Sottostante(i):** Totalenergies SE (ISIN: FR0000120271), AXA SA (ISIN: FR0000120628), Credit Agricole SA (ISIN: FR0000045072) e ORANGE SA (ISIN: FR0000133308)
- **Valore Rettificato:** per un Sottostante, il Valore Rettificato in un qualsiasi giorno di mercato aperto tra la Data di Trade (esclusa) e la Data di Valutazione Finale (inclusa) è uguale al suo Valore Rettificato del giorno di mercato aperto precedente moltiplicato per il suo Rendimento giornaliero, meno il suo Dividendo fisso se questo giorno è una Data di stacco del Dividendo Fisso. Il Valore Rettificato non può essere inferiore a zero. Il Valore Rettificato alla Data di Trade è uguale al suo Valore Iniziale.
- **Rendimento giornaliero:** per un Sottostante, il Valore di Chiusura in un qualsiasi giorno di mercato aperto più il dividendo ordinario lordo staccato tra il giorno di mercato aperto precedente e l'attuale, e poi diviso per il suo Valore di Chiusura nel giorno di mercato aperto precedente.
- **Performance del Sottostante:** per un Sottostante, (a) il Valore Rettificato di tale Sottostante in un qualsiasi giorno di mercato aperto tra la Data di Trade (esclusa) e la Data di Valutazione Finale (inclusa) diviso il suo Valore Iniziale Rettificato, meno (b) 100%, espresso in percentuale
- **Performance del Sottostante Peggior:** la Performance del Sottostante con la più bassa Performance del Sottostante
- **Valore Iniziale:** per un Sottostante, il Valore di Chiusura del Sottostante alla Data di Trade
- **Valore di Chiusura:** per un Sottostante, il valore del Sottostante alla chiusura delle negoziazioni del mercato di riferimento in un qualsiasi giorno di mercato aperto
- **Valore Iniziale Rettificato:** per un Sottostante, il Valore Rettificato del Sottostante alla Data di Valutazione Iniziale
- **Valore Finale Rettificato:** per un Sottostante, il Valore Rettificato del Sottostante alla Data di Valutazione Finale
- **Valore di Esercizio:** 60% del rispettivo Valore Iniziale
- **Importo Nominale:** EUR 1.000
- **Prezzo di Emissione:** EUR 1.000
- **Importo di Interessi:** 1.75% moltiplicato per l'Importo Nominale
- **Date:**
  - **Data di Emissione:** 23 settembre 2021
  - **Data di Scadenza:** 11 settembre 2026
  - **Data di Trade:** 13 settembre 2021
  - **Date di Pagamento:** 7 giorni lavorativi dopo ciascuna Data di Valutazione (diversa dalla Data di Valutazione Iniziale)
  - **Data di Valutazione Iniziale:** 23 settembre 2021
  - **Date di Valutazione Autocall:** 13 Giugno 2022, 13 Settembre 2022, 13 Dicembre 2022, 13 Marzo 2023, 13 Giugno 2023, 13 Settembre 2023, 13 Dicembre 2023, 13 Marzo 2024, 13 Giugno 2024, 13 Settembre 2024, 13 Dicembre 2024, 13 Marzo 2025, 13 Giugno 2025, 15 Settembre 2025, 15 Dicembre 2025, 13 Marzo 2026, 15 Giugno 2026
  - **Date di Valutazione Interessi:** 13 Dicembre 2021, 14 Marzo 2022, 13 Giugno 2022, 13 Settembre 2022, 13 Dicembre 2022, 13 Marzo 2023, 13 Giugno 2023, 13 Settembre 2023, 13 Dicembre 2023, 13 Marzo 2024, 13 Giugno 2024, 13 Settembre 2024, 13 Dicembre 2024, 13 Marzo 2025, 15 Settembre 2025, 15 Dicembre 2025, 13 Marzo 2026, 15 Giugno 2026
  - **Data di Valutazione Finale:** 2 Settembre 2026

| i | Sottostante (i)   | Dividendo Fisso | Data di stacco del Dividendo Fisso | i | Sottostante (i)      | Dividendo Fisso | Data di stacco del Dividendo Fisso |
|---|-------------------|-----------------|------------------------------------|---|----------------------|-----------------|------------------------------------|
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR        | 21 Settembre 2021                  | 2 | AXA SA               | 1.50 EUR        | 06 Maggio 2022                     |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR        | 03 Gennaio 2022                    | 2 | AXA SA               | 1.50 EUR        | 05 Maggio 2023                     |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR        | 22 Marzo 2022                      | 2 | AXA SA               | 1.50 EUR        | 03 Maggio 2024                     |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR        | 21 Giugno 2022                     | 2 | AXA SA               | 1.50 EUR        | 05 Maggio 2025                     |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR        | 21 Settembre 2022                  | 2 | AXA SA               | 1.50 EUR        | 04 Maggio 2026                     |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR        | 02 Gennaio 2023                    | 3 | Credit Agricole S.A. | 0.80 EUR        | 23 Maggio 2022                     |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR        | 22 Marzo 2023                      | 3 | Credit Agricole S.A. | 0.80 EUR        | 22 Maggio 2023                     |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR        | 21 Giugno 2023                     | 3 | Credit Agricole S.A. | 0.80 EUR        | 20 Maggio 2024                     |

Natixis Internal Reference: 53052

|   |                   |          |                   |   |                      |          |                  |
|---|-------------------|----------|-------------------|---|----------------------|----------|------------------|
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 22 Settembre 2023 | 3 | Credit Agricole S.A. | 0.80 EUR | 19 Maggio 2025   |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 02 Gennaio 2024   | 3 | Credit Agricole S.A. | 0.80 EUR | 18 Maggio 2026   |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 25 Marzo 2024     | 4 | Orange SA            | 0.30 EUR | 13 Dicembre 2021 |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 24 Giugno 2024    | 4 | Orange SA            | 0.30 EUR | 14 Giugno 2022   |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 27 Settembre 2024 | 4 | Orange SA            | 0.30 EUR | 05 Dicembre 2022 |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 06 Gennaio 2025   | 4 | Orange SA            | 0.30 EUR | 13 Giugno 2023   |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 24 Marzo 2025     | 4 | Orange SA            | 0.30 EUR | 04 Dicembre 2023 |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 23 Giugno 2025    | 4 | Orange SA            | 0.30 EUR | 11 Giugno 2024   |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 22 Settembre 2025 | 4 | Orange SA            | 0.30 EUR | 02 Dicembre 2024 |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 05 Gennaio 2026   | 4 | Orange SA            | 0.30 EUR | 13 Giugno 2025   |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 23 Marzo 2026     | 4 | Orange SA            | 0.30 EUR | 04 Dicembre 2025 |
| 1 | TOTAL ENERGIES SE | 0.66 EUR | 22 Giugno 2026    | 4 | Orange SA            | 0.30 EUR | 12 Giugno 2026   |

#### Liquidazione anticipata e rettifiche contrattuali

Il regolamento del prodotto prevede che, al verificarsi di alcuni eventi predefiniti, ulteriori rispetto a quelli descritti sopra e relativi, principalmente, ma non esclusivamente, ai Sottostanti o all'Emittente del prodotto (ivi incluso il possibile venir meno della sua capacità di eseguire le necessarie operazioni di copertura), potrebbero essere applicate al prodotto delle rettifiche per tenere conto dell'evento rilevante oppure potrebbe essere disposto il rimborso anticipato del prodotto. Il valore corrisposto in caso di rimborso anticipato potrebbe essere inferiore al capitale originariamente investito.

#### Investitori Ai Dettaglio A Cui Si Intende Commercializza re Il Prodotto

Questo prodotto è inteso per investitori al dettaglio che:

- hanno obiettivi di accrescimento del capitale e obiettivi di rendita
- sono consapevoli e capaci di sostenere una perdita totale del capitale e accettano il rischio di credito dell'Emittente e del Garante
- hanno una tolleranza al rischio congrua con l'indicatore di rischio in questo documento
- hanno una conoscenza ed esperienza sufficiente con prodotti come quello descritto in questo documento
- hanno un orizzonte temporale di investimento minimo uguale al minimo periodo di detenzione raccomandato

#### QUALI SONO I RISCHI E QUAL È IL POTENZIALE RENDIMENTO?

##### Indicatore Sintetico di Rischio



← Rischio più basso Rischio più alto →



L'indicatore di rischio presuppone che il prodotto sia mantenuto fino al 11 Settembre 2026. Il rischio effettivo può variare in misura significativa in caso di disinvestimento in una fase iniziale così che la somma rimborsata potrebbe essere minore. Potrebbe non essere possibile vendere facilmente il prodotto o potrebbe essere possibile venderlo soltanto ad un prezzo che incide significativamente sull'importo incassato.

L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Esso esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti sul mercato o a causa della nostra incapacità di pagarvi quanto dovuto. Abbiamo classificato questo prodotto al livello 5 su 7, che corrisponde alla classe di rischio media-alta. Questo prende in considerazione due elementi: 1) il rischio di mercato - che classifica le perdite potenziali dalle performance future ad un livello medio-alto; e 2) il rischio di credito che stima molto improbabile che condizioni di mercato sfavorevoli influenzino la capacità dell'Emittente e il Garante di pagarvi. **Riceverete pagamenti nella valuta del prodotto, che potrebbe essere diversa dalla vostra valuta nazionale. In questo caso, prestate attenzione al rischio di cambio. Il rendimento finale che otterrete dipende dal tasso di cambio tra le due valute. Questo rischio non è considerato nell'indicatore sopra riportato.** Questo prodotto non comprende alcuna protezione dalla performance futura del mercato; pertanto potreste perdere il vostro intero investimento o parte di esso. Se l'Emittente e il Garante non siamo in grado di pagarvi quanto dovuto, potreste perdere il vostro intero investimento.

#### Scenari di Performance

L'evoluzione di mercato futura non può essere predetta accuratamente. Gli scenari mostrati costituiscono soltanto una indicazione di alcuni dei possibili risultati sulla base dei recenti rendimenti. I rendimenti reali potrebbero essere inferiori.

| Investimento EUR 10.000 |                                       |            |            |  |
|-------------------------|---------------------------------------|------------|------------|--|
| SCENARI                 |                                       | 1 anno     | 3 anni     | 4,9 anni<br>(Periodo di detenzione raccomandato) |
| Scenario di stress      | Possibile rimborso al netto dei costi | EUR 316    | EUR 3.199  | EUR 2.069  |
|                         | Rendimento medio per ciascun anno     | -96,84%    | -31,61%    | -27,30%  |
| Scenario sfavorevole    | Possibile rimborso al netto dei costi | EUR 6.884  | EUR 6.327  | EUR 5.729  |
|                         | Rendimento medio per ciascun anno     | -31,16%    | -14,15%    | -10,66%  |
| Scenario moderato       | Possibile rimborso al netto dei costi | EUR 9.126  | EUR 10.400 | EUR 10.385                                       |
|                         | Rendimento medio per ciascun anno     | -8,74%     | 1,32%      | 0,77%  |
| Scenario favorevole     | Possibile rimborso al netto dei costi | EUR 10.503 | EUR 11.383 | EUR 13.479                                       |
|                         | Rendimento medio per ciascun anno     | 5,03%      | 4,41%      | 6,23%  |

Questa tabella mostra gli importi del possibile rimborso nei prossimi 4,9 anni, in scenari differenti, assumendo che Lei investa EUR 10.000. Gli scenari presentati mostrano la possibile performance dell'investimento. Possono essere confrontati con gli scenari di altri prodotti. Gli scenari presentati sono una stima della performance futura sulla base di prove relative alle variazioni passate del valore di questo investimento e non sono un indicatore esatto. Gli importi rimborsati varieranno a seconda della performance del mercato e del periodo di tempo per cui è mantenuto il investimento. Lo scenario di stress indica quale essere l'importo rimborsato in circostanze di mercato estreme, e non tiene conto della situazione in cui non siamo grado di pagarvi.

Le cifre riportate comprendono tutti i costi del prodotto in quanto tale, ma possono non comprendere tutti i costi da voi pagati al consulente o al distributore.

Natixis Internal Reference: 53052

Le cifre non tengono conto della vostra situazione fiscale personale, che può incidere anch'essa sull'importo del rimborso.

## COSA ACCADE SE NATIXIS NON È IN GRADO DI CORRISPONDERE QUANTO DOVUTO?

Se l'Emittente e / o il Garante diventano soggetti a misure di risoluzione sotto forma di strumento "bail-in", il suo reclamo può ridursi a zero, essere convertito in Equity o la sua scadenza può essere posticipata. Questo prodotto non è coperto da un sistema di indennizzo degli investitori o da un sistema di garanzia. Qualora dell'Emittente e il garante non fossero in grado di corrispondervi gli importi dovuti, potreste perdere, in tutto o in parte, il capitale investito. Inoltre si segnala che i pagamenti potrebbero subire ritardi.

## QUALI SONO I COSTI?

La diminuzione del rendimento (Reduction in Yield - RIY) esprime l'impatto dei costi totali sostenuti sul possibile rendimento dell'investimento.

I costi totali tengono conto dei costi una tantum, correnti e accessori.

Gli importi qui riportati corrispondono ai costi cumulativi del prodotto in tre periodi di detenzione differenti. Comprendono le potenziali penali per uscita anticipata. Questi importi si basano sull'ipotesi che siano investiti EUR 10.000. Gli importi sono stimati e potrebbero cambiare in futuro.

### Andamento dei costi nel tempo

La persona che vende questo prodotto o fornisce consulenza riguardo ad esso potrebbe addebitare altri costi, nel qual caso deve fornire informazioni su tali costi e illustrare l'impatto di tutti i costi sull'investimento nel corso del tempo.

| Investimento EUR 10.000                   |  |  |   |
|---|--|--|---|
| SCENARI                                   | In caso di disinvestimento dopo 1 anno | In caso di disinvestimento dopo 3 anni | In caso di disinvestimento alla fine del periodo di detenzione raccomandato |
| Costi totali                              | EUR 663                                | EUR 748                                | EUR 697   |
| Diminuzione del rendimento (RIY) per anno | 6,63%                                  | 2,39%                                  | 1,33%   |

### Composizione dei costi

La seguente tabella presenta:

- l'impatto, per ciascun anno, dei differenti tipi di costi sul possibile rendimento dell'investimento alla fine del periodo di detenzione raccomandato;
- il significato delle differenti categorie di costi.

| Questa tabella mostra l'impatto sul rendimento per anno |  |       |   |
|---|--|-------|---|
| Costi una tantum  | Costi di ingresso                                  | 1,33% | Impatto dei costi da sostenere al momento della sottoscrizione dell'investimento. L'impatto di questi costi è già incluso nel prezzo. |
|   | Costi di uscita                                    | 0,00% | Impatto dei costi di uscita dall'investimento alla scadenza   |
| Costi correnti  | Costi di transazione del portafoglio               | 0,00% | Impatto dei nostri costi di acquisto e vendita degli investimenti Sottostanti per il prodotto   |
|   | Altri costi correnti                               | 0,00% | Impatto dei costi che tratteniamo ogni anno per gestire i vostri investimenti.  |
| Oneri accessori   | Commissioni di performance                         | 0,00% | Impatto della commissione di performance.   |
|   | Carried interests (commissioni di overperformance) | 0,00% | Non applicabile   |

## PER QUANTO TEMPO DEVO DETENERLO? POSSO RITIRARE IL CAPITALE PREMATURAMENTE?

### Periodo di detenzione raccomandato: 4,9 anni.

Il periodo di detenzione raccomandato corrisponde alla data di scadenza del prodotto, in quanto il prodotto è ideato per essere tenuto fino a scadenza. Qualsiasi raccomandazione circa il periodo di detenzione potrebbe essere irrilevante per un investitore speculativo. Per gli investitori che acquistano il prodotto per operazioni di copertura, il periodo di detenzione dipende dal periodo di detenzione del rischio sottostante.

Natixis può fornire un prezzo indicativo per il prodotto agli investitori che lo richiedono. Qualora volesse vendere il presente prodotto prima della Data di Maturazione, il prezzo del prodotto dipenderebbe dai valori di mercato al momento da scelto per la vendita. In tal caso potreste subire una parziale o totale perdita del capitale investito. Maggiori informazioni saranno rese disponibili ove richieste.

Il Manufacturer non ha alcun obbligo di garantire un mercato secondario per il prodotto ma potrebbe decidere, caso per caso, di riacquistare il prodotto. Ulteriori informazioni sono disponibili su richiesta.

## COME PRESENTARE RECLAMI?

In relazione ad ogni reclamo circa il servizio connesso a questo prodotto, contattate il vostro consulente personale. Nel caso in cui vogliate presentare, in qualunque momento, un reclamo in relazione a questo prodotto o il servizio ricevuto, potete farlo contattando il vostro consulente personale oppure inviando il vostro reclamo al seguente indirizzo postale Service de traitement des réclamations - Banque de Grande Clientèle, 47 quai d'Austerlitz, 75013 Paris - France ovvero al seguente indirizzo email [reclamations-bgc@natixis.com](mailto:reclamations-bgc@natixis.com) oppure attraverso il seguente link: [www.natixis.com/natixis/jcms/rpaz5\\_55348/en](https://www.natixis.com/natixis/jcms/rpaz5_55348/en)

## ALTRE INFORMAZIONI RILEVANTI

Il prospetto nell'ambito del quale il prodotto è emesso (un prospetto di base, come di volta in volta modificato ed integrato dai relativi supplementi, e integrato dalle rilevanti condizioni definitive e, a seconda dei casi, dalla rilevante nota di sintesi della specifica emissione) è reso disponibile gratuitamente dall'Emittente all'indirizzo: Natixis Equity Solutions, 47 quai d'Austerlitz, 75013 Paris - France e potrebbe essere disponibile al sito internet <https://equityderivatives.natixis.com>.

Le informazioni contenute in questo Documento contenente le Informazioni Chiave (Key Information Document - KID) non costituiscono una raccomandazione ad acquistare o vendere il prodotto e non deve in alcun modo sostituire una consultazione su base individuale della banca dell'investitore o del suo consulente personale. Potete ottenere informazioni aggiuntive sul prodotto dal vostro consulente finanziario. Questo KID è un documento pre-contrattuale che vi fornisce le principali informazioni sul prodotto (inter alia, caratteristiche, rischi, costi). Qualora eseguite un'operazione relativamente al prodotto, vi sarà inviata una conferma a seguito dell'operazione.