

# Documento contenente le informazioni chiave

Ref.: NLBNPIT1UFL5-2023-10-02T21:06:30

## 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 costi, i guadagni, i rischi e le perdite potenziali di questo prodotto e di aiutarvi a fare un raffronto con altri prodotti d'investimento.

## PRODOTTO

### Mini Future (Call)

|                                   |                                                                                                                                                                        |
|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>ISIN</b>                       | NLBNPIT1UFL5                                                                                                                                                           |
| <b>Quotazione</b>                 | Borsa Italiana                                                                                                                                                         |
| <b>Offerta pubblica</b>           | Sì (Italia)                                                                                                                                                            |
| <b>Emittente</b>                  | BNP Paribas Issuance B.V.                                                                                                                                              |
| <b>Garante</b>                    | BNP Paribas S.A.                                                                                                                                                       |
| <b>Produttore</b>                 | BNP Paribas S.A.<br><a href="https://investimenti.bnpparibas.it">https://investimenti.bnpparibas.it</a><br>Contattate il numero 0800 924 043 per maggiori informazioni |
| <b>Autorità competente</b>        | Autorité des marchés financiers (AMF) è responsabile della vigilanza di BNP Paribas S.A. in relazione al presente documento contenente le informazioni chiave          |
| <b>Data di Produzione del KID</b> | 02.10.2023 (21:06:30)                                                                                                                                                  |

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

## COS'È QUESTO PRODOTTO?

### ► TIPO

Questo prodotto è un certificate, un valore mobiliare. Non offre alcuna protezione del capitale rispetto al rischio di mercato.

### ► TERMINE

Questo prodotto ha una durata residua prestabilita e sarà liquidato alla Data di Liquidazione.

### ► OBIETTIVI

L'obiettivo di questo prodotto è di fornire un rendimento, se previsto, a condizioni predeterminate. Il prodotto è esposto, con effetto leva, a qualsiasi variazione del Sottostante: in particolare si possono ottenere rendimenti positivi in caso di variazioni positive del Sottostante.

Il prodotto scade anticipatamente se nel corso della sua durata si verifica un Evento di Rimborso Anticipato. Un Evento di Rimborso Anticipato si verifica se il Prezzo del Sottostante è uguale o minore al Livello di Knock-out in qualsiasi momento, durante il Periodo di Osservazione. In questo caso il prodotto scade e rimborserà un ammontare equivalente al valore residuale se il Prezzo Finale è superiore al Livello Strike (Prezzo di Esercizio Capitalizzato), convertito nella Valuta del prodotto. Se il Prezzo Finale è uguale o inferiore al Livello Strike (Prezzo di Esercizio Capitalizzato), il prodotto scade anticipatamente e il suo valore si azzera.

Inoltre, l'Emittente ha il diritto di richiamare il prodotto in date prestabilite previa comuniazione delle stesse (Date di Valutazione).

In seguito al richiamo dell'Emittente e fatto salvo che un Evento di Rimborso Automatico non si sia precedentemente verificato, riceverai il controvalore di Rimborso, alla relativa Data di Rimborso. Tale controvalore è uguale al valore per il quale il Prezzo di Riferimento è superiore al Livello Strike (Prezzo di Esercizio Capitalizzato), convertito nella Valuta del prodotto.

Il Livello Strike (Prezzo di Esercizio Capitalizzato) viene rettificato quotidianamente per riflettere la componente di finanziamento basata su più un margine determinato da BNP Paribas Arbitrage S.N.C. Poiché i Contratti Futures hanno una data di scadenza, il Futures corrente viene sostituito prima della sua scadenza, da un altro contratto Futures con, fatto salvo la data di scadenza, le medesime caratteristiche (cd "roll-over").

Il Livello di Knock-out viene rettificato quotidianamente in riferimento al Livello di Knock-out Percentuale. Conseguentemente il Livello di Knock-out è costantemente maggiore del Livello Strike (Prezzo di Esercizio Capitalizzato). In questo modo il prodotto non diviene necessariamente privo di valore in conseguenza di un Rimborso Automatico.

|                                        |                                        |
|----------------------------------------|----------------------------------------|
| <b>Data di Emissione</b>               | 18.09.2023                             |
| <b>Data di Esercizio</b>               | 21.12.2035                             |
| <b>Data di Valutazione</b>             | 21.12.2035                             |
| <b>Data di Liquidazione (Scadenza)</b> | 04.01.2036                             |
| <b>Periodo di Osservazione</b>         | 18.09.2023 fino a 21.12.2035 (incluso) |
| <b>Valuta del Prodotto</b>             | EUR                                    |

|                                                |                                                                                                                                                 |
|------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Valore di Rimborso Anticipato</b>           | Prezzo determinato da BNP Paribas Arbitrage S.N.C. sulla base del valore più basso del Sottostante nel giorno di Rimborso Automatico Anticipato |
| <b>Livello Knock-out</b>                       | USD 12,38 (al 02.10.2023)                                                                                                                       |
| <b>Livello Strike</b>                          | USD 11,25 (al 02.10.2023)                                                                                                                       |
| <b>Distanza percentuale Strike - Knock-out</b> | 10,00%                                                                                                                                          |
| <b>Parità</b>                                  | 1                                                                                                                                               |
| <b>Tipo</b>                                    | Long                                                                                                                                            |
| <b>Tipologia di Liquidazione (Rimborso)</b>    | Contanti                                                                                                                                        |

|                               |                                                                                                                                                        |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Nome del Sottostante</b>   | CBOE VIX Futures Oct 23 (UXV3, <a href="http://www.cboe.com/micro/vix/vixfuturesprices.aspx">http://www.cboe.com/micro/vix/vixfuturesprices.aspx</a> ) |
| <b>Valuta del Sottostante</b> | USD                                                                                                                                                    |
| <b>Mercato di Riferimento</b> | S&P Dow Jones Indices LLC ("SPDJ")                                                                                                                     |
| <b>Prezzo del Sottostante</b> | Prezzo del Sottostante come determinato in via continuativa dal Mercato di Riferimento                                                                 |
| <b>Prezzo di Riferimento</b>  | Prezzo di Chiusura sul Mercato di Riferimento In corrispondenza della Data di Valutazione                                                              |

▶ **INVESTITORI AL DETTAGLIO A CUI SI INTENDE COMMERCIALIZZARE IL PRODOTTO**

- sono in grado di sopportare perdite fino all'intero Importo investito più i costi.
- hanno un orizzonte di investimento breve termine (fino a tre anni).
- sono alla ricerca di un investimento in un prodotto di incremento del capitale per poter diversificare il loro portafoglio complessivo.
- sono stati informati o dispongono di una sufficiente conoscenza dei mercati finanziari, del loro funzionamento e dei relativi rischi, nonché del mercato di riferimento del Sottostante.

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

INDICATORE DI RISCHIO



Per informazioni dettagliate su tutti i rischi, fate riferimento alla sezione rischi del Prospetto di Base come specificato nella seguente sezione "Altre informazioni rilevanti".

## SCENARI DI PERFORMANCE

Gli scenari riportati sono illustrazioni basate sui risultati passati e su alcune ipotesi. Nel futuro i mercati potrebbero avere un andamento molto diverso.

| Orizzonte temporale raccomandato |                                                                                                           | Periodo di Riferimento (1 giorno di calendario)                         |
|----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|
| Esempio di investimento          |                                                                                                           | EUR 10.000,00<br>In caso di disinvestimento dopo 1 giorno di calendario |
| Scenario Minimo                  | Non esiste un rendimento minimo garantito. Potreste perdere il vostro intero investimento o parte di esso |                                                                         |
| Scenario stress                  | Possibile rimborso al netto dei costi                                                                     | EUR 7.521,00                                                            |
|                                  | Rendimento percentuale (non annualizzato)                                                                 | -24,79%                                                                 |
| Scenario sfavorevole             | Possibile rimborso al netto dei costi                                                                     | EUR 8.514,00                                                            |
|                                  | Rendimento percentuale (non annualizzato)                                                                 | -14,86%                                                                 |
| Scenario moderato                | Possibile rimborso al netto dei costi                                                                     | EUR 9.644,00                                                            |
|                                  | Rendimento percentuale (non annualizzato)                                                                 | -3,56%                                                                  |
| Scenario favorevole              | Possibile rimborso al netto dei costi                                                                     | EUR 10.823,00                                                           |
|                                  | Rendimento percentuale (non annualizzato)                                                                 | 8,23%                                                                   |

Gli scenari favorevole, moderato e sfavorevole rappresentano possibili esiti del vostro investimento, e sono stati calcolati sulla base di simulazioni che utilizzano la performance passata del sottostante fino ad un massimo di 5 anni.

## COSA ACCADE SE BNP PARIBAS S.A. NON È IN GRADO DI CORRISPONDERE QUANTO DOVUTO?

Vi informiamo che BNP Paribas, che agisce in qualità di Garante, è un istituto di credito autorizzato in Francia e, pertanto, è soggetto al regime di risoluzione introdotto dalla Direttiva UE in materia di risanamento e risoluzione delle crisi bancarie del 15 maggio 2014. Questa normativa, tra l'altro,

riconosce alle autorità deliberanti il potere di modificare le condizioni principali della suddetta garanzia, di ridurre gli importi dovuti dal Garante in conformità alle condizioni della suddetta garanzia (fino al loro azzeramento) e di convertire gli importi dovuti ai sensi della garanzia in azioni o altri titoli del Garante. In caso di insolvenza o assoggettamento da procedura fallimentare o altra procedura concorsuale, o in caso di risoluzione ai sensi della normativa applicabile, potreste non riuscire a recuperare, in toto o in parte, l'importo (eventualmente) dovuto dal Garante in relazione al prodotto ai sensi della garanzia e potreste ricevere in sostituzione di tale importo un titolo diverso emesso dal Garante, il cui valore potrebbe essere considerevolmente inferiore all'importo che avreste percepito alla scadenza del prodotto.

## QUALI SONO I COSTI?

Il soggetto che fornisce consulenza sul prodotto o che lo vende potrebbe addebitare altri costi, nel qual caso fornirà informazioni su tali costi, illustrandone l'impatto sull'investimento.

### ► ANDAMENTO DEI COSTI NEL TEMPO

Le tabelle mostrano gli importi prelevati dall'investimento per coprire diversi tipi di costi. Tali importi dipendono dall'entità dell'investimento, dalla durata della detenzione del prodotto e dall'andamento del prodotto. Gli importi sono qui riportati a fini illustrativi e si basano su un importo esemplificativo dell'investimento e su diversi possibili periodi di investimento.

Si è ipotizzato quanto segue:

- Recupero dell'importo investito (rendimento annuo dello 0 %)
- EUR 10.000,00 di investimento

| In caso di disinvestimento dopo 1 giorno di calendario |            |
|--------------------------------------------------------|------------|
| <b>Costi totali</b>                                    | EUR 441,00 |
| Incidenza dei costi *                                  | 4,41%      |

\* Ciò illustra l'effetto dei costi su un periodo di detenzione inferiore a un anno. Questa percentuale non può essere direttamente confrontata con le cifre relative all'impatto dei costi fornite per altri prodotti.

Una parte dei costi può essere condivisa con il soggetto che vende il prodotto per coprire i costi dei servizi che fornisce. L'importo verrà comunicato.

### ► COMPOSIZIONE DEI COSTI

| Costi una tantum di ingresso o di uscita                            |                                                                                                                                                                                                            | In caso di disinvestimento dopo il Periodo di Riferimento (1 giorni di calendario) |
|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|
| Costi di ingresso                                                   | 3,19% dell'importo pagato al momento dell'acquisto. Questi costi sono già inclusi nel prezzo di acquisto di questo prodotto.                                                                               | EUR 319,00                                                                         |
| Costi di uscita                                                     | 1,20% del vostro investimento. Questi costi si applicano solo in caso di disinvestimento prima della scadenza del prodotto. L'importo indicato presuppone che si applichino condizioni normali di mercato. | EUR 120,00                                                                         |
| Costi correnti                                                      |                                                                                                                                                                                                            |                                                                                    |
| Commissioni di gestione e altri costi amministrativi o di esercizio | 0,02% del valore dell'investimento all'anno relativo al Periodo di detenzione raccomandato. Si tratta di una stima basata sui costi effettivi.                                                             | EUR 2,34                                                                           |

## PER QUANTO TEMPO DEVO DETENERLO? POSSO RICEVERE IL CAPITALE ANTICIPATAMENTE?

Il periodo di detenzione raccomandato per il prodotto è: 1 giorno di calendario (Periodo di Riferimento)

Il periodo di detenzione raccomandato sopra indicato coincide con il periodo campione utilizzato per elaborare gli scenari di performance e calcolare i costi del prodotto. A causa del suo effetto leva, il prodotto reagisce ai minimi movimenti di prezzo del Sottostante che generano un utile o una perdita in tempi non prevedibili. Per gli investitori in cerca di rendimento, il rischio associato al prodotto aumenta considerevolmente se la sua detenzione si protrae oltre il periodo campione. Per gli investitori che acquistano il prodotto a fini di copertura, il periodo di detenzione dipende dall'orizzonte temporale di copertura del singolo investitore.

In normali condizioni di mercato, potrete vendere questo prodotto sul mercato secondario, a un prezzo che dipende dai parametri prevalenti sui mercati in quel momento e che potrebbe risultare inferiore al capitale investito.

## COME PRESENTARE RECLAMI?

Qualsiasi reclamo riguardante la condotta del proprio consulente o intermediario può essere presentato al diretto interessato.

Qualsiasi reclamo riguardante il prodotto può essere presentato per iscritto all'indirizzo seguente: Global Markets - Distribution, Piazza Lina Bo Bardi 3, 20124 Milano, inviando un'e-mail all'indirizzo di posta elettronica [investimenti@bnpparibas.com](mailto:investimenti@bnpparibas.com), ovvero compilando il modulo disponibile al seguente link <https://investimenti.bnpparibas.it>

## ALTRE INFORMAZIONI RILEVANTI

Maggiori informazioni sul prodotto ed in particolare il prospetto, qualsiasi supplemento ed i final terms, inclusi i rischi a esso connessi, vengono pubblicate sul sito dell'emittente <https://investimenti.bnpparibas.it>, nel rispetto delle norme di legge. Per informazioni più dettagliate, in particolare in relazione alla struttura dei rischi associati al prodotto, è necessario prestare attenzione ai documenti sopra riportati.

È vietata l'offerta o la vendita, diretta o indiretta, di questo prodotto negli Stati Uniti d'America o a US Person. Il termine "US Person" è definito nella Regulation S del Securities Act del 1933. L'offerta di questo prodotto non è stata registrata ai sensi del Securities Act.