

Termsheet vom 14.10.2020

Capital Protection on Lafargeholcim, Nestlé, Roche, Swisscom, Zurich / Safe Plus 90 Zertifikat 2013 II

90.00% Kapitalschutz | Autocallable

Verfall 29.09.2023; emittiert in CHF; kotiert an SIX Swiss Exchange AG

ISIN CH0215666055 | Valorenummer 21566605 | SIX Symbol LTQAKV

Dieses Produkt ist nach den Bestimmungen des "Rahmenvertrages für Pfandbesicherte Zertifikate" der SIX Swiss Exchange AG besichert. Einzelheiten zur Pfandbesicherung sind im nachfolgenden Abschnitt aufgeführt: "[Information zur Pfandbesicherung](#)".

Interessierte Anleger sollten den untenstehenden Abschnitt «bedeutende Risiken» sowie die im Programm enthaltenen «Risikofaktoren» sorgfältig lesen. Mit einer Anlage in dieses Produkt riskiert der Anleger das investierte Kapital. Der Anleger kann das investierte Kapital teilweise oder vollständig verlieren.

Obwohl möglicherweise Übersetzungen in andere Sprachen vorliegen, ist einzig das Final Termsheet und das Programm in englischer Sprache rechtlich verbindlich.

Dieses Produkt ist ein derivatives Finanzinstrument nach schweizer Recht. Es ist kein Anteil einer kollektiven Kapitalanlage im Sinne der Art. 7 ff. des schweizerischen Bundesgesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG) und ist daher weder registriert noch überwacht von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA. Anleger geniessen nicht den durch das KAG vermittelten spezifischen Anlegerschutz.

Das Verlustrisiko des Anlegers aufgrund des Ausfalls der Emittentin und gegebenenfalls der Garantin ist durch die Pfandbesicherung lediglich vermindert.

Dieses Dokument ist kein Prospekt im Sinne von Art. 1156 des schweizerischen Obligationenrechts (OR) bzw. von Art. 40 ff. FIDLEG.

I. PRODUKTEBESCHREIBUNG

Produktebeschreibung

Dieses Produkt bietet dem Anleger die periodische Möglichkeit, eine Couponzahlung bei Vorzeitiger Rückzahlung zu erhalten. Eine Vorzeitige Rückzahlung findet statt, sofern an einem der vordefinierten Autocall Beobachtungstage die entsprechenden Voraussetzungen erfüllt sind. Hat keine Vorzeitige Rückzahlung stattgefunden, erhält der Anleger am Rückzahlungsdatum eine Barauszahlung entsprechend der Denomination multipliziert mit dem Kapitalschutz, wie im Abschnitt "Rückzahlung" beschrieben.

Die Bedingungen dieser Emission wurden angepasst.

| BASISWERTE | | | | | | |
|-------------------------------|-----------------------|------------------|----------------------|-----------------------------------|-----|---------|
| Basiswert | Referenzbörse | Bloomberg Ticker | Anfangslevel (100%)* | Autocall Trigger Level (100.00%)* | | |
| LAFARGEHOLCIM LTD | SIX Swiss Exchange AG | LHN SW | CHF | 64.0952 | CHF | 64.0952 |
| NESTLE SA-REG | SIX Swiss Exchange AG | NESN SW | CHF | 63.25 | CHF | 63.25 |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | SIX Swiss Exchange AG | ROG SW | CHF | 243.90 | CHF | 243.90 |
| SWISSCOM AG-REG | SIX Swiss Exchange AG | SCMN SW | CHF | 434.60 | CHF | 434.60 |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG-REG | SIX Swiss Exchange AG | ZURN SW | CHF | 232.90 | CHF | 232.90 |

| PRODUKTDDETAILS | |
|--------------------|--|
| Valorenummer | 21566605 |
| ISIN | CH0215666055 |
| SIX Symbol | LTQAKV |
| Ausgabepreis | 100.00% |
| Emissionsvolumen | CHF 10'000'000 (mit Aufstockungsmöglichkeit) |
| Denomination | CHF 1 |
| Auszahlungswährung | CHF |
| Kapitalschutz | 90.00% |

* Levels sind in Prozent des Anfangslevels ausgedrückt

| | | | | | |
|-----------------------------------|-----------------------------------|--------------------|----------------------------|--|--|
| Zeichnung 08.07.2013 - 30.09.2013 | Erster Börsenhandeltag 11.10.2013 | Verfall 29.09.2023 | Rückzahlungstag 10.10.2023 | | |
| | | | | | |

| | |
|------------------------------|---|
| Bondfloor bei Ausgabe | 77.48% (implizierter Zins p.a.: 1.51%) |
| Ausgabeaufschlag | 3.50% wird direkt von der Depotbank erhoben |

DATEN

| | |
|----------------------------------|---|
| Zeichnungsbeginn | 08.07.2013 |
| Zeichnungsschluss | 30.09.2013 00:00 CEST |
| Fixierung | 30.09.2013 |
| Liberierung | 11.10.2013 |
| Erster Börsenhandelstag | 11.10.2013 |
| Letzte/r Handelstag/-zeit | 29.09.2023 / Börsenschluss |
| Verfall | 29.09.2023 (vorbehältlich Anpassung bei Marktstörungen) |
| Rückzahlungstag | 10.10.2023 (vorbehältlich Anpassung bei Abwicklungsstörungen) |

| Autocall Beobachtungstage / Vorzeitige Rückzahlungstage | Autocall Beobachtungstag | Autocall Trigger Level^a | Vorzeitiger Rückzahlungstag | Couponzahlung bei Vorzeitiger Rückzahlung | |
|--|---------------------------------|---|------------------------------------|--|------------------|
| 1 | 29.09.2016 | 100.00% | 06.10.2016 | CHF 0.09 | NICHT AUTOCALLED |
| 2 | 29.09.2017 | 100.00% | 06.10.2017 | CHF 0.18 | NICHT AUTOCALLED |
| 3 | 01.10.2018 | 100.00% | 08.10.2018 | CHF 0.37 | NICHT AUTOCALLED |
| 4 | 30.09.2019 | 100.00% | 07.10.2019 | CHF 0.46 | NICHT AUTOCALLED |
| 5 | 29.09.2020 | 100.00% | 06.10.2020 | CHF 0.65 | NICHT AUTOCALLED |
| 6 | 29.09.2021 | 100.00% | 06.10.2021 | CHF 0.74 | |
| 7 | 29.09.2022 | 100.00% | 06.10.2022 | CHF 0.83 | |
| 8 | 29.09.2023* | 100.00% | 10.10.2023** | CHF 1.02 | |

^aLevels sind in Prozent des Anfangslevels ausgedrückt

*der letzte Autocall Beobachtungstag entspricht dem Verfall

**der letzte Vorzeitige Rückzahlungstag entspricht dem Rückzahlungsdatum

Sofern einer der oben genannten Autocall Beobachtungstage kein Börsenhandelstag für einen Basiswert ist, wird der nächstfolgende Börsenhandelstag für diesen Basiswert der entsprechende Autocall Beobachtungstag sein. Die General Terms and Conditions finden für die Autocall Beobachtungstage identisch Anwendung wie für den Verfall. Sofern einer der obgenannten Vorzeitigen Rückzahlungstage kein Arbeitstag ist, wird der entsprechende Vorzeitige Rückzahlungstag auf den nächstfolgenden Arbeitstag verschoben.

RÜCKZAHLUNG

Vorausgesetzt, dass keine Vorzeitige Rückzahlung an einem der festgelegten Autocall Beobachtungstage ausgelöst wurde, erhält der Anleger am Rückzahlungsdatum von der Emittentin pro Produkt eine Barauszahlung in der Auszahlungswährung, entsprechend folgender Formel:
Denomination x Kapitalschutz

| | |
|-------------------------------|---|
| Anfangslevel | Der offizielle Schlusskurs des Basiswertes an der entsprechenden Referenzbörse bei Fixierung, festgelegt durch die Berechnungsstelle. |
| Endlevel | Der offizielle Schlusskurs des Basiswertes an der entsprechenden Referenzbörse bei Verfall, festgelegt durch die Berechnungsstelle. |
| Vorzeitige Rückzahlung | Unter der Voraussetzung, dass an einem der im Voraus festgesetzten Autocall Beobachtungstage der offizielle Schlusskurs aller Basiswerte auf oder über dem entsprechenden Autocall Trigger Level liegt, wird eine Vorzeitige Rückzahlung stattfinden und das Produkt verfällt mit sofortiger Wirkung. Der Anleger erhält am entsprechenden Vorzeitigen Rückzahlungstag eine Barauszahlung, die sich wie folgt berechnet: Denomination plus Couponzahlung bei Vorzeitiger Rückzahlung für den entsprechenden Autocall Beobachtungstag, wie in obiger Tabelle definiert. Es erfolgen keine weiteren Zahlungen. |

GENERELLE INFORMATION

| | |
|---------------------------------|--|
| Emittentin | Leonteq Securities AG, Guernsey Branch, St. Peter Port, Guernsey (Rating: Fitch BBB- mit stabilem Ausblick, JCR BBB+ mit stabilem Ausblick, Aufsichtsbehörde: FINMA / GFSC) |
| Sicherungsgeber (COSI) | Leonteq Securities AG, Guernsey Branch, St. Peter Port, Guernsey |
| Lead Manager | Leonteq Securities AG, Zürich, Schweiz |
| Berechnungsstelle | Leonteq Securities AG, Zürich, Schweiz |
| Zahlstelle | Leonteq Securities AG, Zürich, Schweiz |
| Vertriebsentschädigungen | Relevant Fees (inkl. allfälliger MwSt. Es wird auf den Abschnitt "Vergütungen an Dritte" sowie die "General Terms and Conditions" des Programmes verwiesen) |
| Kotierung | SIX Swiss Exchange AG; gehandelt an SIX Swiss Exchange - Structured Products Die Kotierung wird beantragt. |
| Sekundärmarkt | Veröffentlichungen täglicher Preisindikationen zwischen 09:15 und 17:15 CET unter www.leonteq.com , Refinitiv [SIX Symbol]=LEOZ oder [ISIN]=LEOZ sowie Bloomberg [ISIN] Corp oder LEOZ. |
| Quotierungsart | Sekundärmarktpreise werden dirty quotiert, d. h. die Marchzinsen (Stückzinsen) sind im Preis enthalten. |
| Quotierungstyp | Sekundärmarktpreise werden in Prozent quotiert. |
| Abwicklungsart | Barabwicklung |
| Minimaler Anlagebetrag | CHF 3'000 |

| | |
|--|---|
| Kleinste Handelsmenge | CHF 1 |
| Verkaufsrestriktionen | Es wurde/wird nichts unternommen, um ein öffentliches Angebot der Produkte oder den Besitz oder die Verteilung von Angebotsunterlagen in Bezug auf die Produkte in Rechtsgebieten zu erlauben, in denen Massnahmen hierzu erforderlich sind. Hinsichtlich dessen kann jedes Angebot, jeder Verkauf oder jede Lieferung der Produkte oder die Verbreitung oder Veröffentlichung von Angebotsunterlagen in Bezug auf die Produkte nur in oder aus einem Rechtsgebiet in Übereinstimmung mit den geltenden Gesetzen und Vorschriften erfolgen, wenn weder die Emissionsparteien noch der Lead Manager in irgendeiner Form hierdurch verpflichtet werden. Beschränkungen der grenzüberschreitenden Kommunikation und des grenzüberschreitenden Geschäfts betreffend die in Frage stehenden Produkte und Informationen bleiben - aufgrund rechtlicher Überlegungen - vorbehalten. Die wichtigsten Rechtsgebiete, in denen die Produkte nicht öffentlich vertrieben werden dürfen, sind der EWR, UK, Hongkong und Singapur. Die Produkte dürfen nicht innerhalb der Vereinigten Staaten bzw. nicht an oder auf Rechnung oder zugunsten von US-Personen (wie in Regulation S definiert) angeboten oder verkauft werden. Detaillierte Informationen über Verkaufsrestriktionen sind dem Programm zu entnehmen, welches auf www.leonteq.com veröffentlicht ist und kostenlos beim Lead Manager bezogen werden kann. |
| Clearing | SIX SIS AG, Euroclear, Clearstream |
| Verwahrungsstelle | SIX SIS AG |
| Öffentliches Angebot nur in | Schweiz |
| Verbriefung | Wertrechte |
| Anwendbares Recht / Gerichtsstand | Schweizerisches Recht / Zürich |

Die Definition "Emissionspartei(en)", wie hierin verwendet, bezeichnet die Emittentin, wie im Abschnitt „Generelle Information“ definiert.

STEUERN SCHWEIZ

| | |
|---|---|
| Stempelsteuer | Für die schweizerische Umsatzabgabe handelt es sich um steuerbare Urkunden (Obligationen), weshalb allfällige Sekundärmarkttransaktionen nach den allgemeinen Grundsätzen der Umsatzabgabe unterliegen (TK22). |
| Einkommenssteuer (für natürliche, in der Schweiz ansässige Personen) | Dieses Produkt ist als transparent und überwiegend einmalverzinslich (IUP) zu qualifizieren. Dementsprechend unterliegt bei natürlichen, in der Schweiz ansässigen Personen, welche das Produkt im Privatvermögen halten, der (aufgrund der modifizierten Differenzbesteuerung zu ermittelnde) Wertzuwachs auf dem Obligationenteil im Zeitpunkt des Verkaufs bzw. der Rückzahlung der Direkten Bundessteuer. Der Wert des Obligationenteils im Emissionszeitpunkt entspricht dem Bondfloor bei Ausgabe pro Einheit. Für einen Investor, der das Produkt bei Emission kauft und bis Verfall hält, ist die Wertdifferenz zwischen dem Bondfloor bei Liberierung und dem Bondfloor am Rückzahlungsdatum steuerrelevant. Demgegenüber stellt der auf die Option zurückzuführende Wertzuwachs einen Kapitalgewinn dar und unterliegt bei den vorstehend erwähnten Investoren nicht der direkten Bundessteuer. Die kantonale und kommunale einkommenssteuerliche Behandlung kann von der steuerlichen Behandlung bei der direkten Bundessteuer abweichen. Generell ist die einkommenssteuerliche Behandlung jedoch gleich. |
| Verrechnungssteuer | Dieses Produkt unterliegt nicht der schweizerischen Verrechnungssteuer. |

Am 1. Januar 2017 hat die Schweiz den automatischen Informationsaustausch in Steuersachen („AIA-Standard“) mit der EU und Australien, Jersey, Guernsey, Isle of Man, Island, Norwegen, Japan, Kanada und Südkorea umgesetzt. Die Schweiz verhandelt die Einführung des AIA-Standards auch mit anderen Ländern. In diesem Zusammenhang wurde der EU Steuerrückbehalt für schweizerische Zahlstellen sowie die abgeltende Quellensteuer mit dem Vereinigten Königreich und Österreich aufgehoben.

Diese Steuerinformationen gewähren nur einen generellen Überblick über die möglichen schweizerischen Steuerfolgen, die zum Zeitpunkt der Emission mit diesem Produkt verbunden sind, und sind rechtlich nicht verbindlich. Steuergesetze und die Praxis der Steuerverwaltung können sich - möglicherweise rückwirkend - jederzeit ändern.

Anlegern und potenziellen Anlegern von Produkten wird geraten, ihren persönlichen Steuerberater bzgl. der für die schweizerische Besteuerung relevanten Auswirkungen von Erwerb, Eigentum, Verfügung, Verfall oder Ausübung bzw. Rückzahlung der Produkte angesichts ihrer eigenen besonderen Umstände zu konsultieren. Die Emissionsparteien sowie der Lead Manager lehnen jegliche Haftung im Zusammenhang mit möglichen Steuerfolgen ab.

Informationen zur Bondfloor Besteuerung

Aktualisierte Informationen zum Bondfloor, sofern das Produkt über einen solchen verfügt (gemäss den obigen Abschnitten "Produktdetails" und "Steuern Schweiz"), können auf der Webpage der Eidgenössischen Steuerverwaltung (ESTV) gefunden werden: www.ictax.admin.ch. Anleger sollten sich bewusst sein, dass der Wert des Bondfloods für Steuerzwecke sowohl bei Ausgabe/Kauf als auch bei Verkauf/Rückzahlung des Produktes in Schweizer Franken (CHF) umgerechnet wird, sofern das Produkt in einer anderen Währung als CHF ausgegeben wird. Daher unterliegen Anleger in Bezug auf die Berechnung des steuerbaren Einkommens sowie bei der Verrechnungssteuer, falls anwendbar, dem Fremdwährungsrisiko. Die Verrechnungssteuer fällt auf dem Bondfloor jedoch nur an, wenn der Bondfloor bei Rückzahlung (in %) grösser ist als der Bondfloor bei Ausgabe (in %).

PRODUKTDOKUMENTATION

Das Termsheet, das spätestens am Ausgabebetrag erhältlich sein wird, sowie das Finale Termsheet enthalten die Informationen, die gemäß Art. 5 des Kollektivanlagengesetzes („KAG“) in seiner unmittelbar vor dem Inkrafttreten des schweizerischen Finanzdienstleistungsgesetzes („FIDLEG“) gültigen Fassung für einen definitiven, vereinfachten Prospekt vorgeschrieben sind, aber es handelt sich dabei nicht um einen Prospekt gemäß Art. 40 FIDLEG bzw. Art. 1156 des schweizerischen Obligationenrechts. In Bezug auf die Produkte wurde und wird kein Basisinformationsblatt gemäß Art. 60 FIDLEG oder ein anderes, vergleichbares Dokument gemäß FIDLEG erstellt.

Es ist kein Prospekt von einer schweizerischen Prüfstelle gemäß Art. 52 FIDLEG geprüft oder freigegeben worden, und die in Bezug auf den Prospekt erstellte Dokumentation entspricht möglicherweise nicht den Offenlegungsanforderungen, die für einen Prospekt gelten würde, der gemäß FIDLEG von einer solchen Prüfstelle genehmigt wurde. Das Termsheet enthält eine Zusammenfassung ausgewählter Produktinformationen und dient lediglich zu Informationszwecken. **Einzig das Final Termsheet, zusammen mit dem Derivate Programm der jeweiligen Emittentin, welches bei Fixierung Gültigkeit hat und alle weiteren Bedingungen enthält (das "Programm"), gelten als rechtsverbindliche Dokumentation des Produkts ("Product Documentation");** entsprechend sollte das Final Termsheet immer zusammen mit dem Programm gelesen werden. Begriffe, welche im Final

Termsheet verwendet, dort aber nicht definiert werden, haben die Bedeutung, welche ihnen gemäss des Programmes zukommt. **Obwohl möglicherweise Übersetzungen in andere Sprachen vorliegen, ist einzig das Final Termsheet und das Programm in englischer Sprache rechtlich verbindlich.**

Anleger werden in der Art und Weise rechtsgültig informiert, wie dies in den Bedingungen des Programmes vorgesehen ist. Zudem werden sämtliche Änderungen, die die Bedingungen dieses Produkts betreffen, im entsprechenden Termsheet auf www.leonteq.com in der Rubrik „Produkte“ oder für kotierte Produkte in irgendeiner anderen Form, die gemäss den Bestimmungen und Regularien der SIX Exchange Regulation AG zulässig ist, veröffentlicht. Mitteilungen an Anleger, welche die Emissionsparteien betreffen, werden in der Rubrik „Über Leonteq“ auf der Website www.leonteq.com und/oder auf der Webpage der entsprechenden Emissionspartei veröffentlicht.

Während der gesamten Laufzeit des Produkts kann die Produktdokumentation kostenlos vom Lead Manager an der Europaallee 39, 8004 Zürich (Schweiz), oder via Telefon (+41 58 800 1111*), Fax (+41-(0)58-800 1010) oder E-Mail (termsheet@leonteq.com) bestellt werden. Wir machen Sie darauf aufmerksam, dass alle Gespräche auf Linien, welche mit einem Asterisk (*) gekennzeichnet sind, aufgezeichnet werden. Bei Ihrem Anruf unter der jeweiligen Nummer gehen wir davon aus, dass Sie mit dieser Geschäftspraxis einverstanden sind.

II. GEWINN- UND VERLUSTAUSSICHTEN

Dieses Produkt fällt in die Kategorie „Kapitalschutz“. Abhängig davon, ob das Produkt über einen Cap verfügt oder nicht, kann der Gewinn, den ein Anleger mit diesem Produkt realisieren kann, entweder limitiert (mit Cap) oder unbeschränkt (ohne Cap) sein. Ein allfälliger Gewinn setzt sich aus dem investierten Kapital (exkl. Transaktions- und anderer Kosten) multipliziert mit dem Kapitalschutz plus zusätzlichen (garantierten und/oder bedingten) Zahlungen, wie z. B. Coupon- oder Partizipationszahlungen, Bonis oder anderen Vergütungen zusammen.

Der negativen Entwicklung des Basiswertes ist der Anleger nur bis zum Kapitalschutzlevel ausgesetzt.

Bitte lesen Sie die Abschnitte „Produktebeschreibung“ und „Rückzahlung“ für detailliertere Informationen zur Ausgestaltung dieses Produkts.

III. BEDEUTENDE RISIKEN

PRODUKTSPEZIFISCHE RISIKEN

Das Verlustrisiko des Produkts ist begrenzt auf die Differenz zwischen dem Kaufpreis (sofern höher als der Kapitalschutzlevel) und dem Kapitalschutzlevel. Der Preis des Produktes kann jedoch während der Laufzeit auch unterhalb des Kapitalschutzes notieren.

ZUSÄTZLICHE RISIKOFAKTOREN

Anleger sollten sich vergewissern, dass sie die Eigenschaften des Produkts sowie das Risiko, das sie beabsichtigen einzugehen, verstehen. Ob ein Produkt für einen bestimmten Anleger geeignet ist, sollte dieser aufgrund seiner eigenen Umstände und seiner eigenen finanziellen Situation beurteilen. Die Produkte beinhalten wesentliche Risiken, inklusive dem Risiko, dass sie wertlos verfallen können. Anleger sollten in der Lage sein, unter gewissen Umständen einen Totalverlust ihres investierten Geldes zu verkraften. Anleger sollten die folgenden wichtigen Risikofaktoren sowie das Kapitel „Risikofaktoren“ des Programmes beachten.

Vorliegend handelt es sich um ein strukturiertes Produkt, welches derivative Komponenten beinhaltet. Anleger sollten sicherstellen, dass ihre Berater dieses Produkt unter Berücksichtigung der finanziellen Situation des Anlegers, seiner Investmenterfahrung und seiner Anlageziele auf die Eignung für das Portfolio des Anlegers überprüft haben.

Die Produktebedingungen können während der Laufzeit des Produkts gemäss den Bestimmungen des Programmes angepasst werden.

Anleger, deren übliche Währung nicht der Währung entspricht, in welcher die Rückzahlung des Produkts stattfindet, sollten sich des möglichen Währungsrisikos bewusst sein.

Der Wert des Produkts korreliert allenfalls nicht mit demjenigen des Basiswertes.

Marktrisiken

Die allgemeine Marktentwicklung von Wertpapieren ist insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte, die ihrerseits von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird (sog. Marktrisiko), abhängig. Änderungen von Marktpreisen wie Zinssätze, Preisen von Rohwaren oder entsprechende Volatilitäten können die Bewertung des Basiswertes bzw. des Produkts negativ beeinflussen. Ausserdem besteht das Risiko, dass während der Laufzeit oder bei Verfall des Produkts in den jeweiligen Basiswerten und/oder an deren Börsen bzw. Märkten Marktstörungen (wie Handels- oder Börsenunterbrüche bzw. Einstellung des Handels) oder andere nicht voraussehbare Ereignisse eintreten. Solche Ereignisse können sich auf den Zeitpunkt der Rückzahlung und/oder auf den Wert des Produktes auswirken.

Keine Dividendenzahlung

Dieses Produkt gewährt keinen Anspruch auf Rechte und/oder Zahlungen aus den Basiswerten, wie z. B. Dividendenzahlungen und wirft daher, vorbehaltlich etwaiger in diesem Termsheet explizit vorgesehener Couponzahlungen oder Dividendenzahlungen, keinen laufenden Ertrag ab. Mögliche Wertverluste des Produkts können daher nicht durch andere Erträge kompensiert werden.

Kreditrisiko der Emissionspartei(en)

Das Verlustrisiko des Anlegers aufgrund des Ausfalls der Emittentin ist durch die Pfandbesicherung lediglich vermindert. Zur Besicherung dieses Produktes wurden zu Gunsten der SIX Swiss Exchange AG Sicherheiten bei der SIX SIS AG hinterlegt. Nach Insolvenz der Emittentin werden die hinterlegten Sicherheiten zur Rückzahlung dieses Produktes herangezogen.

Sekundärmarkt

Die Emittentin und/oder der Lead Manager oder irgendeine von der Emittentin damit beauftragte Drittpartei beabsichtigen, unter normalen Marktverhältnissen, gemäss den COSI Market Making Pflichten Angebots- und Nachfragepreise für die Produkte zu stellen. Doch die Emittentin und/oder der Lead Manager behalten sich das Recht vor, das Stellen von Angebots- und Nachfragepreisen für die Dauer des Auftretens von aussergewöhnlichen Marktverhältnissen einzustellen. Bei speziellen Marktsituationen, wenn die Emittentin und/oder der Lead Manager nicht in der Lage sind, Absicherungsgeschäfte zu tätigen, oder wenn es sehr schwierig ist, solche Geschäfte abzuschliessen, kann sich der Spread zwischen Angebots- und Nachfragepreisen zwischenzeitlich vergrössern, um das wirtschaftliche Risiko der Emittentin und/oder des Lead Managers zu begrenzen.

Illiquiditätsrisiko

Es besteht die Möglichkeit, dass einer oder, sofern anwendbar, mehrere der Basiswerte während der Laufzeit des Produktes illiquid sind oder werden. Illiquidität eines Basiswertes kann zu vergrösserten Spannen (Spreads) zwischen Angebots- und Nachfragepreisen des Produktes und zu verlängerten Zeitperioden für den Erwerb und/oder den Verkauf des Basiswertes respektive für den Erwerb, die Abwicklung oder den Abbau des/der Absicherungsgeschäfte(s) oder –bestands/bestände sowie für das Realisieren, Einfordern und Auszahlen des Erlöses aus solchen Absicherungsgeschäften oder –beständen führen. Dies kann eine verzögerte Rückzahlung oder Lieferung und/oder einen angepassten Rückzahlungsbetrag zur Folge haben, wie von der Berechnungsstelle in angemessener Weise festgelegt.

ZUSÄTZLICHE INFORMATIONEN

Prudentielle Aufsicht

Leonteq Securities AG ist als Wertpapierhaus zugelassen und untersteht der prudentiellen Überwachung durch die FINMA. Leonteq Securities AG, Guernsey Branch ist durch die Guernsey Financial Services Commission ("GFSC") reguliert.

Interessenskonflikte

Die Emissionsparteien und/oder der Lead Manager und/oder von diesen beauftragte Drittparteien können von Zeit zu Zeit, auf eigene Rechnung oder auf Rechnung eines Dritten, Positionen in Wertschriften, Währungen, Finanzinstrumenten oder anderen Anlagen, welche den Produkten dieses Dokuments als Basiswerte dienen, eingehen. Sie können diese Anlagen kaufen oder verkaufen, als Market Maker auftreten und gleichzeitig auf der Angebots- wie auch der Nachfrageseite aktiv sein. Die Handels- oder Absicherungsgeschäfte der Emittentin und/oder der Lead Manager und/oder entsprechend beauftragter Drittparteien können den Preis des Basiswerts beeinflussen und können einen Einfluss darauf haben, ob der relevante Barrier Level, falls es einen solchen gibt, erreicht wird.

Vergütungen an Dritte

Unter Umständen verkaufen die Emittentin und/oder der Lead Manager dieses Produkt an Finanzinstitutionen oder Zwischenhändler mit einem Discount zum Verkaufspreis, oder sie erstatten einen gewissen Betrag an diese Käufer zurück (es wird auf den Abschnitt „Generelle Information“ verwiesen).

Zusätzlich können die Emittentin und/oder der Lead Manager für erbrachte Leistungen zur Qualitätssteigerung und im Zusammenhang mit zusätzlichen Dienstleistungen in Bezug auf die Produkte, periodische Entschädigungen („trailer fees“) an Vertriebspartner bezahlen.

Weitere Informationen werden auf Verlangen zur Verfügung gestellt.

Couponzahlung

Sofern das Produkt eine Couponzahlung vorsieht, ist der Anleger nur dann berechtigt die entsprechende Couponzahlung zu erhalten, wenn er das Produkt spätestens am Bankarbeitstag vor dem jeweiligen Coupon Ex-Date zu dem an diesem Zeitpunkt geltenden Preis, erworben hat/nicht veräussert hat.

Kein Angebot

Das Termsheet dient primär zu Informationszwecken und stellt daher weder eine Empfehlung zum Erwerb von Finanzprodukten noch eine Offerte oder Einladung zur Offertstellung dar.

Keine Gewähr

Die Emittentin, der Lead Manager sowie eine allenfalls von diesen beauftragte Drittpartei können keine Gewähr leisten für irgendwelche Informationen in diesem Dokument, welche sie von unabhängigen Quellen bezogen haben oder die von solchen Quellen abgeleitet sind.

INFORMATION ZUR PFANDBESICHERUNG

COSI® Collateral Secured Instruments – Investor Protection engineered by SIX.

Dieses Produkt (im Folgenden «Pfandbesichertes Produkt») ist nach den Vorschriften des «Rahmenvertrages für Pfandbesicherte Zertifikate» von SIX Swiss Exchange («Rahmenvertrag») besichert.

Die Leonteq Securities AG, Guernsey Branch, St. Peter Port, Guernsey («Sicherungsgeber») hat den Rahmenvertrag entweder in ihrer Funktion als Emittent, oder andernfalls zusammen mit dieser, am 5. Oktober 2012 abgeschlossen, und der Sicherungsgeber ist zur Sicherstellung des jeweiligen Wertes der Pfandbesicherten Produkte zu Gunsten von SIX Swiss Exchange verpflichtet. Die Rechte der Anleger im Zusammenhang mit der Besicherung der Pfandbesicherten Produkte ergeben sich aus dem Rahmenvertrag. Die Grundzüge der Besicherung sind in einem Informationsblatt von SIX Swiss Exchange zusammengefasst, das auf «www.six-swissexchange.com» verfügbar ist. Der Rahmenvertrag wird den Anlegern auf Verlangen vom Emittenten kostenlos in deutscher Fassung oder in englischer Übersetzung zur Verfügung gestellt. Der Rahmenvertrag kann über den Lead Manager an der Europaallee 39, 8004 Zürich (Schweiz), oder via Telefon (+41 58 800 1111), Fax (+41-(0)58-8001010) oder E-Mail (termsheet@leonteq.com) bezogen werden.

Die Kosten für die Dienstleistung der SIX Swiss Exchange zur Besicherung von Pfandbesicherten Produkten, welche derzeit bis zu 15 Basispunkte (0.15%) des Gesamtwerts der hinterlegten Sicherheiten betragen, wie auch die Finanzierungskosten dieser Sicherheiten können in die Preisfindung für ein Pfandbesichertes Produkt einfließen und sind daher allenfalls vom Anleger zu tragen.

Der Anleger unterliegt hinsichtlich der Auszahlung des anteilmässigen Netto-Verwertungserlöses den Bonitätsrisiken von SIX Swiss Exchange und der Finanzintermediäre entlang der Auszahlungskette. Die Auszahlung an die Anleger kann sich aus tatsächlichen oder rechtlichen Gründen verzögern.

Sofern sich die Berechnung des Aktuelle Wertes eines Pfandbesicherten Produktes als fehlerhaft erweist, kann die Besicherung des Pfandbesicherten Produktes ungenügend sein.

Der Emittent kann neben der Primärkotierung der Pfandbesicherten Produkte an der SIX Swiss Exchange eine Kotierung oder Zulassung zum Handel an einer oder mehreren Sekundärbörsen anstreben. Sämtliche mit einer Kotierung oder Zulassung zum Handel der Pfandbesicherten Produkte an einer Sekundärbörse verbundenen Aspekte und Ereignisse sind unter dem Rahmenvertrag unbeachtlich. Insbesondere stellen Ereignisse, die mit einer Kotierung oder Zulassung der Pfandbesicherten Produkte zum Handel an einer Sekundärbörse zusammenhängen, wie die Aussetzung des Market Making an einer Sekundärbörse oder die Dekotierung der Pfandbesicherten Produkte von einer Sekundärbörse, unter dem Rahmenvertrag keinen Verwertungsfall dar. SIX Swiss Exchange ist nach eigenem freien Ermessen berechtigt, den Eintritt eines Verwertungsfalles sowie die Fälligkeit der Pfandbesicherten Produkte nach dem Rahmenvertrag in den Ländern, in denen eine Kotierung oder Zulassung der Pfandbesicherten Produkte zum Handel an einer Sekundärbörse besteht, öffentlich bekannt zu machen sowie die Sekundärbörsen oder sonstigen Stellen darüber zu informieren.

Der aktuelle Wert dieses COSI Produktes wird nach Methode «B (Bond Floor)» berechnet. Informationen zur Berechnungsmethode sind auf «www.six-swissexchange.com» verfügbar.

14.07.2015 - Namensänderung

Capital Protection on Lafargeholcim, Nestlé, Roche, Swisscom, Zurich / Safe Plus 90 Zertifikat 2013 II
 90.00% Kapitalschutz | Autocallable
 ISIN: CH0215666055
 SIX Symbol: LTOAKV

Stichtag: 14.07.2015
 Basiswert: HOLCIM LTD-REG

Die HOLCIM LTD-REG ändert ihren Firmennamen.
 Die Bedingungen dieser Emission wurden wie folgt angepasst:

| | | |
|-----------------------|-------------------|-----------------------|
| Basiswert neu: | LAFARGEHOLCIM LTD | (alt: HOLCIM LTD-REG) |
| Bloomberg Ticker neu: | LHN VX | (alt: HOLN VX) |

08.09.2015 - Ausgabe von Gratisaktien

Capital Protection on Lafargeholcim, Nestlé, Roche, Swisscom, Zurich / Safe Plus 90 Zertifikat 2013 II
 90.00% Kapitalschutz | Autocallable
 ISIN: CH0215666055
 SIX Symbol: LTOAKV

Stichtag: 08.09.2015
 Basiswert: LAFARGEHOLCIM LTD

Kapitalerhöhung der LAFARGEHOLCIM LTD durch die Ausgabe von Gratisaktien im Verhältnis 1:20
 Die Bedingungen dieser Emission wurden wie folgt angepasst:

| | | |
|-----------------------------|-------------|--------------------|
| Anfangslevel neu: | CHF 64.0952 | (alt: CHF 67.3000) |
| Autocall Trigger Level neu: | CHF 64.0952 | (alt: CHF 67.3000) |

23.10.2017 - Änderung des Tickers

Capital Protection on Lafargeholcim, Nestlé, Roche, Swisscom, Zurich / Safe Plus 90 Zertifikat 2013 II
 90.00% Kapitalschutz | Autocallable
 ISIN: CH0215666055
 SIX Symbol: LTOAKV

Stichtag: 23.10.2017
 Basiswert: ZURICH INSURANCE GROUP AG-REG

ZURICH INSURANCE GROUP AG-REG hat ihren Bloomberg Ticker geändert.
 Die Bedingungen dieser Emission wurden wie folgt angepasst:

| | | |
|-----------------------|---------|----------------|
| Bloomberg Ticker neu: | ZURN SW | (alt: ZURN VX) |
|-----------------------|---------|----------------|

23.10.2017 - Änderung des Tickers

Capital Protection on Lafargeholcim, Nestlé, Roche, Swisscom, Zurich / Safe Plus 90 Zertifikat 2013 II
 90.00% Kapitalschutz | Autocallable
 ISIN: CH0215666055
 SIX Symbol: LTOAKV

Stichtag: 23.10.2017
 Basiswert: ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN

ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN hat ihren Bloomberg Ticker geändert.
 Die Bedingungen dieser Emission wurden wie folgt angepasst:

| | | |
|-----------------------|--------|---------------|
| Bloomberg Ticker neu: | ROG SW | (alt: ROG VX) |
|-----------------------|--------|---------------|

23.10.2017 - Änderung des Tickers

Capital Protection on Lafargeholcim, Nestlé, Roche, Swisscom, Zurich / Safe Plus 90 Zertifikat 2013 II

90.00% Kapitalschutz | Autocallable

ISIN: CH0215666055

SIX Symbol: LTQAKV

Stichtag: 23.10.2017

Basiswert: SWISSCOM AG-REG

SWISSCOM AG-REG hat ihren Bloomberg Ticker geändert.

Die Bedingungen dieser Emission wurden wie folgt angepasst:

Bloomberg Ticker neu: SCMN SW (alt: SCMN VX)

23.10.2017 - Änderung des Tickers

Capital Protection on Lafargeholcim, Nestlé, Roche, Swisscom, Zurich / Safe Plus 90 Zertifikat 2013 II

90.00% Kapitalschutz | Autocallable

ISIN: CH0215666055

SIX Symbol: LTQAKV

Stichtag: 23.10.2017

Basiswert: LAFARGEHOLCIM LTD

LAFARGEHOLCIM LTD hat ihren Bloomberg Ticker geändert.

Die Bedingungen dieser Emission wurden wie folgt angepasst:

Bloomberg Ticker neu: LHN SW (alt: LHN VX)

23.10.2017 - Änderung des Tickers

Capital Protection on Lafargeholcim, Nestlé, Roche, Swisscom, Zurich / Safe Plus 90 Zertifikat 2013 II

90.00% Kapitalschutz | Autocallable

ISIN: CH0215666055

SIX Symbol: LTQAKV

Stichtag: 23.10.2017

Basiswert: NESTLE SA-REG

NESTLE SA-REG hat ihren Bloomberg Ticker geändert.

Die Bedingungen dieser Emission wurden wie folgt angepasst:

Bloomberg Ticker neu: NESN SW (alt: NESN VX)

FÜR DEN VERTRIEB IN DER SCHWEIZ

Leonteq Securities AG

Europaallee 39

8004 Zürich, Schweiz

Tel: +41 58 800 1111

termsheet@leonteq.com

www.leonteq.com

FÜR DEN VERTRIEB IM EUROPÄISCHEN WIRTSCHAFTSRAUM (EWR)

Leonteq Securities (Europe) GmbH

Goetheplatz 2

60311 Frankfurt, Deutschland

Tel: +49 69 970 979 900

www.leonteq.de

ZWEIGNIEDERLASSUNGEN

Leonteq Securities (Europe) GmbH

Paris Branch

80 Avenue Marceau

75008 Paris, Frankreich

Tel: +33 (0)1 40 62 79 36

www.leonteq.fr

Leonteq Securities (Europe) GmbH

London Branch

108 Cannon Street

London EC4N 6EU, United Kingdom

Phone: +44 (0)207 467 5350

www.leonteq.co.uk