

CERTIFICATI PHOENIX WORST OF CON NOME COMMERCIALE “PHOENIX SNOWBALL AIRBAG SU BASKET WO” LEGATI ALLE AZIONI BIONTECH SE E MODERNA INC. - APRILE 2024

Prima dell'adesione all'offerta leggere il [Prospetto di Base](#) (Certificates Issuance Programme - 25 May 2020), le [Condizioni Definitive](#) e il [KID](#) (Key Information Document) dello strumento, disponibili anche sul sito internet pubblico di Mediobanca (mediobanca.com/it/prodotti-emessi/index.html). L'approvazione del Prospetto da parte dell'Autorità competente non deve essere intesa come approvazione dello strumento offerto, o ammesso a negoziazione in un mercato regolamentato.

Il Certificato Phoenix Worst Of è uno strumento finanziario che offre protezione del capitale solo in determinate condizioni e pertanto l'investitore potrebbe subire perdite totali o parziali del capitale investito

COME FUNZIONA

Il Certificato Phoenix Worst Of è uno strumento a **capitale condizionatamente protetto** che permette all'investitore di ottenere un **premio periodico condizionato** al fatto che alle Date di Valutazione Intermedie e alla Data di Valutazione Finale le azioni BioNtech SE e Moderna Inc. abbiano un valore superiore o uguale a un livello predeterminato in fase di emissione («Barriera Premio»).

Il premio periodico è caratterizzato da un **effetto memoria**, ovvero, se a una data di valutazione è soddisfatta la condizione per il pagamento del Premio Condizionato, il Certificato corrisponde anche tutti i premi non pagati nelle precedenti Date di Valutazione Intermedie.

A partire dal dodicesimo mese di vita, il Certificato prevede la possibilità di **rimborso anticipato automatico** se nelle Date di Valutazione Intermedie il valore di entrambe le azioni BioNtech SE e Moderna Inc. è pari o superiore ad un livello predeterminato in fase di emissione (“Trigger Rimborso Anticipato”). In tal caso il Certificato sarà liquidato anticipatamente e l'investitore riceverà un importo pari al Valore Nominale, maggiorato del Premio Condizionato, più gli eventuali premi non pagati in precedenza. Qualora non sia rimborsato anticipatamente, il Certificato alla Data di Scadenza rimborserà un importo che dipende dal valore delle azioni BioNtech SE e Moderna Inc. alla Data di Valutazione Finale. In particolare:

(A) se entrambe le azioni BioNtech SE e Moderna Inc. avranno un valore pari o superiore alla Barriera Premio, il Certificato rimborserà un importo pari al Valore Nominale maggiorato del Premio Condizionato, più gli eventuali premi non pagati precedentemente;

(B) se almeno una delle azioni BioNtech SE e Moderna Inc. avrà un valore inferiore alla Barriera Premio, ma entrambe le azioni BioNtech SE e Moderna Inc. avranno un valore pari o superiore alla Barriera Capitale, il Certificato rimborserà un importo pari al Valore Nominale;

(C) se almeno una delle azioni BioNtech SE e Moderna Inc. avrà un valore inferiore alla Barriera Capitale, il Certificato rimborserà un importo commisurato alla performance della peggiore tra le azioni BioNtech SE e Moderna Inc. calcolata a partire dal **Livello Airbag con conseguente perdita, parziale o totale, del capitale investito.**

A CHI SI RIVOLGE

Questo Certificato è quindi adatto a chi si attende un andamento positivo delle azioni BioNtech SE e Moderna Inc. per il periodo di vita del Certificato o comunque una perdita di valore a scadenza non superiore al 50% rispetto ai Valori di Riferimento Iniziali.

*** I Certificati sono strumenti non semplici e possono essere di difficile comprensione.** Si tratta di strumenti finanziari a complessità molto elevata ai sensi della Comunicazione Consob 0097996/14 del 22 dicembre 2014. I Certificati espongono anche l'investitore al rischio di credito dell'emittente. In caso di vendita del Certificato prima della scadenza, gli investitori potrebbero ricevere un importo inferiore rispetto a quello inizialmente investito. **Per le informazioni sui costi e oneri a carico dell'investitore per l'acquisto del Certificato si rinvia al KID** (Key Information Document) dello strumento.

QUANTO PUÒ OTTENERE L'INVESTITORE

PER UN CERTIFICATE DEL VALORE NOMINALE DI 1.000€**

DATA DI VALUTAZIONE	CONDIZIONE	COSA ACCADE
Dal 1° al 11° mese	Se in una delle Date di Valutazione Intermedie Entrambe le azioni BioNtech SE e Moderna Inc. ≥ Barriera Premio	Il Certificato paga il premio mensile pari a €9,20 (0,92%), più gli eventuali premi non pagati in precedenza
	Almeno una delle azioni BioNtech SE e Moderna Inc. < Barriera Premio	Il Certificato non paga premio e si rinvia alla data di valutazione successiva
Dal 12° al 35° mese	Se in una delle Date di Valutazione Intermedie Entrambe le azioni BioNtech SE e Moderna Inc. ≥ Trigger Rimborso Anticipato	Il Certificato scade anticipatamente e rimborsa €1.009,20, più gli eventuali premi non pagati in precedenza
	Almeno una delle azioni BioNtech SE e Moderna Inc. < Trigger Rimborso Anticipato, ma entrambe le azioni BioNtech SE e Moderna Inc. ≥ Barriera Premio	Il Certificato paga il premio mensile pari a €9,20 (0,92%), più gli eventuali premi non pagati in precedenza
	Almeno una delle azioni BioNtech SE e Moderna Inc. < Barriera Premio	Il Certificato non paga premio e si rinvia alla data di valutazione successiva
36° mese (12/04/2024) ***	Se entrambe le azioni BioNtech SE e Moderna Inc. ≥ Barriera Premio	Il Certificato scade e rimborsa €1.009,20, più gli eventuali premi non pagati in precedenza
	Se almeno una delle azioni BioNtech SE e Moderna Inc. < Barriera Premio, ma entrambe le azioni BioNtech SE e Moderna Inc. ≥ Barriera Capitale	Il Certificato scade e rimborsa €1.000
	Se almeno una delle azioni BioNtech SE e Moderna Inc. < Barriera Capitale	Il Certificato scade e paga un importo commisurato alla performance della peggiore tra le azioni BioNtech SE e Moderna Inc. a partire dal Livello Airbag con conseguente perdita, parziale o totale, del capitale investito (<€1.000)

DATA DI PAGAMENTO

IL 5° GIORNO LAVORATIVO DALLA DATA DI VALUTAZIONE

RECORD DATE

IL 2° GIORNO LAVORATIVO PRECEDENTE ALLA RELATIVA DATA DI PAGAMENTO

** Gli importi espressi in percentuale ovvero espressi in euro devono intendersi al lordo delle ritenute fiscali previste per legge

*** Ove non sia scaduto anticipatamente

CARTA D'IDENTITÀ

TIPOLOGIA ACEPI
Certificato a Capitale
Condizionatamente Protetto
EMITTENTE

Mediobanca SpA

RATING EMITTENTE

Fitch - **BBB-**

Standard & Poor's - **BBB**

Moody's - **Baa1**

DISTRIBUTORE

CheBanca! S.p.A.

CODICE ISIN

XS2311910546

SOTTOSTANTE

Azioni BioNtech SE e Moderna Inc.

PREZZO DI EMISSIONE

EUR 1.000

VALORE NOMINALE

EUR 1.000

LOTTO MINIMO

1 Certificate

PERIODO DI COLLOCAMENTO

Dal 16 marzo al 9 aprile 2021, salvo

chiusura anticipata

DATA DI EMISSIONE

14 aprile 2021

DATA DI SCADENZA

19 aprile 2024

VALORI DI RIFERIMENTO INIZIALI

Prezzi di chiusura delle azioni

BioNtech SE e Moderna Inc. il 12

aprile 2021

BARRIERA PREMIO

70% dei Valori di Riferimento Iniziali

BARRIERA CAPITALE

50% dei Valori di Riferimento Iniziali

LIVELLO AIRBAG

50% dei Valori di Riferimento Iniziali

DATE DI VALUTAZIONE INTERMEDIE

Il 12 di ogni mese, da maggio 2021

a marzo 2024 (se giorno festivo, il

giorno feriale successivo)

DATA DI VALUTAZIONE FINALE

12 aprile 2024

TRIGGER RIMBORSO ANTICIPATO

100% dei Valori di Riferimento Iniziali

PREMIO CONDIZIONATO

0,92% mensile (11,04% p.a.)

MERCATO DI NEGOZIAZIONE

EuroTLX – Mediobanca opererà

sul mercato in qualità di liquidity

provider dello strumento



MEDIOBANCA
CERTIFICATES

DISTRIBUITO DA:

CheBanca!
 Gruppo Mediobanca



LE DUE SOCIETÀ

BioNtech SE è un'azienda tedesca di biotecnologia e biofarmaceutica attiva nell'ambito della ricerca, sviluppo e commercializzazione di farmaci. La società, che serve clienti in tutto il mondo, sviluppa un'ampia gamma di prodotti utilizzando diversi approcci scientifici e piattaforme tecnologiche.

Moderna Inc., con sede a Cambridge (Massachusetts), è una società statunitense che opera nel campo delle biotecnologie. L'azienda si concentra sulla scoperta e sviluppo di terapie e vaccini a base di RNA messaggero, sviluppando mRNA per malattie infettive, immuno-oncologiche e cardiovascolari.

AZIONE BIONTECH SE*

BORSA DI QUOTAZIONE

NASDAQ

ISIN

US09075V1026

CAPITALIZZAZIONE DI MERCATO

23,42 miliardi di dollari

PERFORMANCE DA INIZIO ANNO

+19,30%

VALORE MASSIMO NELLE ULTIME 52 SETTIMANE

\$129,54 (10/12/20)

VALORE MINIMO NELLE ULTIME 52 SETTIMANE

\$28,45 (12/03/20)

AZIONE MODERNA INC.*

BORSA DI QUOTAZIONE

NASDAQ

ISIN

US60770K1079

CAPITALIZZAZIONE DI MERCATO

52,46 miliardi di dollari

PERFORMANCE DA INIZIO ANNO

+25,61%

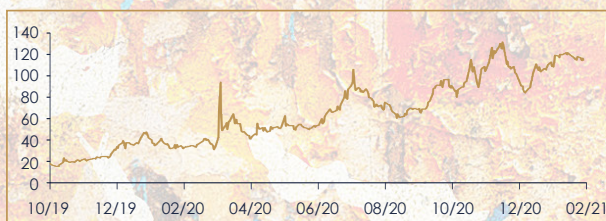
VALORE MASSIMO NELLE ULTIME 52 SETTIMANE

\$185,98 (08/02/21)

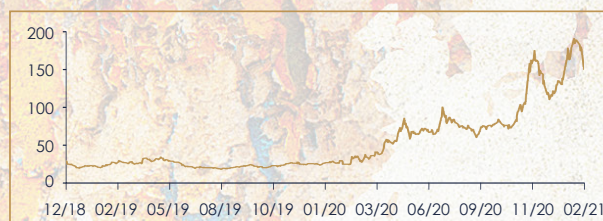
VALORE MINIMO NELLE ULTIME 52 SETTIMANE

\$21,30 (13/03/20)

ANDAMENTO AZIONE BIONTECH SE: DALLA QUOTAZIONE (OTTOBRE 2019)*



ANDAMENTO AZIONE MODERNA INC.: DALLA QUOTAZIONE (DICEMBRE 2018)*



Fonte dei dati: Bloomberg/Reuters e sito internet delle società emittenti lo strumento
L'andamento passato dell'azione non è indicativo, né costituisce garanzia, del relativo andamento futuro
*Grafico e dati aggiornati ai valori del 03/03/2021

COME SI PUÒ SOTTOSCRIVERE IL CERTIFICATE?

Fino al 09/04/2021 presso le filiali CheBanca!, fino al 02/04/2021 per l'offerta fuori sede, fino al 26/03/2021 mediante tecniche di comunicazione a distanza, salvo esaurimento plafond.

CONTATTI

EMITTENTE

mediobanca.com

mediobanca.com/it/prodotti-emessi/index.html

certificates@mediobanca.com

numero verde: 800 44 55 77

DISTRIBUTORE

chebanca.it

Se sei già un cliente: rivolgiti al tuo gestore o alla tua filiale di fiducia oppure chiama il numero verde 800.10.10.30

Se non sei un cliente: (+39) 02.3200.4040

Disclaimer

Il presente documento è stato redatto da Mediobanca - Banca di Credito Finanziario S.p.A. ("Mediobanca") ed è rivolto al pubblico indistinto. Il presente documento ha finalità esclusivamente informativa, promozionale/pubblicitaria, e non costituisce consulenza in materia d'investimenti, consulenza contabile, fiscale o legale, né ricerca in materia di investimenti. Le informazioni sono presentate senza pretesa di esaustività e sono soggette a cambiamenti senza alcun preventivo avviso. Il documento è stato elaborato anche sulla base di dati ed informazioni pubblicamente disponibili, su cui Mediobanca non ha effettuato, direttamente o indirettamente, alcuna verifica autonoma, controllo e/o analisi indipendenti. Qualsiasi risultato passato, simulazione di risultato passato, proiezione, previsione, stima o altra dichiarazione prospettica contenuta nel presente documento, così come qualsiasi informazione o valutazione da essa ricavata ha scopo esclusivamente illustrativo e non è da considerarsi indicatore affidabile di risultati futuri. Mediobanca non rilascia alcuna dichiarazione o garanzia, né assume alcuna responsabilità in merito alla realizzabilità di qualsiasi previsione ivi contenuta. La Banca declina qualsiasi responsabilità derivante dall'utilizzo dei dati, delle informazioni e valutazioni ivi contenute. Le soluzioni ivi rappresentate sono rivolte unicamente a coloro che abbiano conoscenze ed esperienze tali da consentire la valutazione dei relativi rischi e benefici. Eventuali riferimenti ivi contenuti a specifici obiettivi e/o posizioni finanziarie dei destinatari sono da considerarsi generiche assunzioni. Le soluzioni rappresentate nel documento potrebbero non essere appropriate/adatte per il relativo destinatario e vanno in ogni caso valutate dal medesimo anche sulla base della propria posizione fiscale e legale. Si invitano i clienti/investitori ad assumere qualsiasi decisione su strumenti, servizi o operazioni solo dopo attenta presa visione e valutazione di tutta la documentazione (di offerta e/o contrattuale) relativa a tale strumento, servizio o operazione, eventualmente con l'ausilio dei propri consulenti finanziari, legali e/o fiscali. Il destinatario del presente documento è invitato a leggere il Prospetto di Base prima dell'adesione all'offerta. Il Prospetto di Base, così come ogni Supplemento al Prospetto di Base e le Condizioni Definitive sono disponibili sul sito internet pubblico di Mediobanca mediobanca.com/it/prodotti-emessi/index.html, nonché presso la relativa sede legale in Piazzetta Enrico Cuccia 1, 20121 Milano, Italia, e l'ufficio di rappresentanza in Piazza di Spagna 15, 00187 Roma, Italia; copia di tale documentazione può essere ottenuta su richiesta presso la sede legale di Mediobanca, oltre che presso il distributore CheBanca!. L'approvazione del prospetto da parte dell'Autorità competente non deve essere intesa come approvazione degli strumenti offerti, o ammessi alla negoziazione in un mercato regolamentato. State per acquistare un prodotto che non è semplice e può essere di difficile comprensione. Mediobanca ha redatto il Documento contenente le informazioni chiave dello strumento (Key Information Document - KID) ai sensi del Regolamento UE n. 1286/2014 e relativa regolamentazione di attuazione, disponibile sul relativo sito internet pubblico mediobanca.com nella sezione PRIIPS/KID. Lo strumento cui si riferisce il presente documento è qualificato come strumento finanziario a complessità molto elevata ai sensi della Comunicazione Consob n. 0097996 del 22-12-2014; è necessario valutarne attentamente le caratteristiche prima di assumere qualsiasi decisione d'investimento. Gli investimenti in strumenti finanziari comportano un elemento di rischio. L'investimento nello strumento a cui si riferisce il presente documento comporta il rischio di perdita totale del capitale inizialmente investito. Prima della scadenza il valore dell'investimento e l'eventuale reddito da esso derivante possono variare e l'importo inizialmente investito non è garantito. L'investitore è esposto al rischio di credito relativo a Mediobanca e al rischio di assoggettamento del prodotto allo strumento del c.d. "Bail-in", ovvero al rischio che - alle condizioni della Direttiva 2014/59/UE, anche in assenza di una formale dichiarazione di insolvenza di Mediobanca - il valore nominale del prodotto sia svalutato e finanche azzerato o che il prodotto sia convertito in titolo di capitale in via permanente. Mediobanca fa parte di un primario gruppo bancario, le cui società sono impegnate in un'ampia gamma di operazioni finanziarie, attività e servizi di investimento, sia per conto proprio sia per conto dei propri clienti, che rappresentano un potenziale conflitto di interessi. Mediobanca ha adottato misure adeguate per gestire ogni potenziale conflitto di interesse. Il presente documento non può essere in alcun modo riprodotto, fotocopiato o duplicato, in parte o integralmente; né trasmesso o diffuso ad alcuna persona al di fuori dell'originale destinatario, senza il preventivo consenso di Mediobanca; né può essere distribuito, oppure utilizzato da alcuna persona o entità nelle giurisdizioni o nazioni ove un siffatto uso o distribuzione è contrario a prescrizioni legislative o regolamentari. Mediobanca è autorizzata e vigilata dalla Banca Centrale Europea (BCE), Banca d'Italia e Consob, ed è altresì soggetta alla vigilanza delle Autorità locali dei Paesi ove svolge servizi ed attività di investimento. Per ulteriori informazioni si prega di consultare il sito internet mediobanca.com