

Call Warrant auf Holcim

SSPA Produkttyp: Warrant (2100)
Valor: 130682738 / ISIN: CH1306827382

Endgültiges Termsheet
Nur für Marketingzwecke

Informationen zum Produkt & Basiswert

| Basiswert(e) | Referenz-Level | Strike | Bezugsverhältnis |
|---|----------------|-----------|--|
| Holcim Ltd Bloomberg: HOLN SE / Refinitiv: HOLN.S / Valor: 1221405 / ISIN: CH0012214059 | CHF 64,62 | CHF 95,00 | 10:1 (10 Stück(e) beziehen sich auf 1 Basiswert(e)) |

Warrants sind für Anleger mit einer hohen Risikotoleranz. Sie bieten die Möglichkeit, sich mit einem relativ geringen Kapitaleinsatz überproportional an der Wertentwicklung des Basiswerts ihrer Wahl zu beteiligen. Je nach Produkt kann der Anleger von steigenden (Call Warrants) oder fallenden (Put Warrants) Märkten profitieren. Das Verlustrisiko ist auf das investierte Kapital begrenzt.

Der Preis eines Warrants kann durch mehrere Faktoren beeinflusst werden, neben den Kursbewegungen des Basiswerts sind das insbesondere: Zeit bis zum Verfall, implizite Volatilität, risikofreier Zinssatz und erwartete Dividenden.

Produktdetails

| | |
|------------------------|--|
| Wertpapierkennnummern | Valor: 130682738 / ISIN: CH1306827382 |
| Ausgabevolumen | Bis zu 71.000.000 Stücke (Aufstockung möglich) |
| Ausgabepreis | CHF 0,14 (Stücknotierung) |
| Auszahlungswährung | CHF |
| Strike Währung | CHF |
| Optionstyp | Amerikanisch |
| Settlement | In bar |
| Ausübung am Verfalltag | Automatisch |

Daten

| | |
|------------------------------------|---|
| Beginn des öffentlichen Angebotes | 05. Dezember 2023 |
| Festlegungstag (Pricing) | 04. Dezember 2023 |
| Zahltag bei Ausgabe (Emissionstag) | 07. Dezember 2023 |
| Erster Handelstag | 05. Dezember 2023 |
| Ausübungsperiode | 08. Dezember 2023 bis 18. Dezember 2026, 12:00 Uhr Ortszeit Zürich |
| Bewertungstag | Der Bewertungstag entspricht dem Ausübungstag bzw. dem Verfalltag. |
| Bewertungszeit | Zeitpunkt der Bestimmung des Schlusskurses des Basiswerts an der Massgeblichen Börse. |
| Letzter Handelstag / Uhrzeit | 18. Dezember 2026, 12:00 Uhr Ortszeit Zürich |
| Verfalltag (Verfall) | 18. Dezember 2026 (unterliegt den Bestimmungen betreffend Marktstörungen) |
| Fälligkeitstag | 23. Dezember 2026 (unterliegt den Bestimmungen betreffend Marktstörungen) |

Rückzahlung

Während der Ausübungsperiode ist der Wertpapiergläubiger berechtigt, den Warrant auszuüben. Bei einer Ausübung ist der Wertpapiergläubiger berechtigt, von der Emittentin 3 Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag einen Abrechnungsbetrag gemäss folgendem Optionsrecht zu beziehen:

| | |
|-----------------|--|
| Optionsrecht | Barauszahlung des Abrechnungsbetrages in der Auszahlungswährung. Der Abrechnungsbetrag entspricht der Differenz, um die der Abrechnungskurs den Basispreis überschreitet, unter Berücksichtigung des Bezugsverhältnisses, umgerechnet in die Auszahlungswährung, falls zutreffend. Falls der Abrechnungskurs dem Strike entspricht oder niedriger ist, verfällt der ausgeübte Warrant wertlos. Nicht ausgeübte Warrants werden automatisch am Verfalltag ausgeübt. |
| Abrechnungskurs | Offizieller Schlusskurs des Basiswerts, wie am Bewertungstag an der Massgeblichen Börse ermittelt. |

Allgemeine Informationen

| | |
|-----------------------------------|--|
| Emittentin | UBS AG, Zürich |
| Rating der Emittentin | Aa3 Moody's / A+ S&P's / A+ Fitch |
| Aufsichtsbehörde der Emittentin | Eidgenössische Finanzmarktaufsicht (FINMA). Für die Niederlassung London zusätzlich die Financial Conduct Authority (FCA) sowie die Prudential Regulation Authority (PRA). Für die Niederlassung Jersey zusätzlich die Financial Services Commission (JFSC) in Jersey. |
| Federführer | UBS AG, Zürich (UBS Investment Bank) |
| Berechnungsstelle | UBS AG, Zürich |
| Zahlstelle | UBS Switzerland AG |
| Massgebliche Börse | Holcim: SIX Swiss Exchange |
| Börsengeschäftstag | Der Börsengeschäftstag bezeichnet jeden Tag, an dem die Massgebliche Börse für den Handel geöffnet ist, und der Kurs des Basiswerts in Übereinstimmung mit den massgeblichen Regeln bestimmt wird. |
| Kotierung | Keine |
| Sekundärmarkt | Die Emittentin oder der Lead-Manager beabsichtigen, unter normalen Marktbedingungen regelmässig Geld- und/oder Briefkurse für dieses Produkt zu stellen. Die Emittentin oder der Lead-Manager geben jedoch keine festen Zusagen ab, Liquidität mittels Geld und/oder Briefkursen für dieses Produkt zur Verfügung zu stellen, und übernehmen keine rechtliche Verpflichtung, solche Kurse in einer bestimmten Höhe festzulegen oder überhaupt anzubieten. Tägliche Preisindikationen sind, sofern verfügbar, über www.ubs.com/keyinvest abrufbar. |
| Kleinste handelbare Einheit | 1 Warrant(s) |
| Mindestausübungszahl | 1 Warrant(s), Warrants können nur in integralen Vielfachen von 1 ausgeübt werden. |
| Verwahrstelle | UBS |
| Verbriefung | Wertrechte |
| Status | Unbesichert / Nicht nachrangig |
| Anwendbares Recht / Gerichtsstand | Schweizer Recht / Zürich |
| Anpassungen | Während der Laufzeit der Produkte können die Produktdaten angepasst werden. Ausführliche Informationen hinsichtlich der Anpassungen können der Produktdokumentation entnommen werden. |
| Öffentliches Angebot | Schweiz |

Steuerinformationen Schweiz

| | |
|------------------------------|---|
| Eidgenössische Stempelabgabe | Das Produkt ist keine steuerbare Urkunde. Käufe und Verkäufe unterliegen nicht der Umsatzabgabe. |
| Schweizer Einkommenssteuer | In der Schweiz ansässige natürliche Personen, die das Produkt im Privatvermögen halten, erzielen kein steuerbares Einkommen mit einer Anlage in diesem Produkt. |
| Schweizer Verrechnungssteuer | Dieses Produkt unterliegt nicht der schweizerischen Verrechnungssteuer. Allenfalls gelangt eine ausländische Quellensteuer zur Anwendung. |

Diese Steuerinformationen beschreiben die schweizerischen Steuerfolgen des Produkts gemäss den im Zeitpunkt der Emission bestehenden rechtlichen Grundlagen und der Praxis der Steuerbehörden. Die rechtlichen Grundlagen und die Praxis der Steuerbehörden können sich jederzeit ändern, wobei rückwirkende Änderungen nicht ausgeschlossen sind.

Verkaufsbeschränkungen

Wer ein Produkt für den Wiederverkauf erwirbt, darf dieses nicht in einer Rechtsordnung anbieten, wenn die Emittentin dadurch dazu verpflichtet wäre, weitere Dokumente in Bezug auf das Produkt in dieser Rechtsordnung registrieren zu lassen.

Die nachstehend aufgeführten Beschränkungen sind nicht als definitiver Hinweis darauf zu verstehen, ob ein Produkt in einer Rechtsordnung verkauft werden kann. Zusätzliche Verkaufsbeschränkungen über Angebote, Verkäufe oder den Besitz dieses Produkts können in anderen Rechtsordnungen anwendbar sein. Anleger, die dieses Produkt erwerben, sollten sich vor dem Weiterverkauf dieses Produkts diesbezüglich beraten lassen.

Europäischer Wirtschaftsraum - In Bezug auf jeden Mitgliedstaat des Europäischen Wirtschaftsraums (jeweils ein "Mitgliedstaat") darf in einem Mitgliedstaat ein öffentliches Angebot der Produkte nur nach Maßgabe der folgenden Ausnahmen gemäß der Verordnung (EU) 2017/1129 (in ihrer jeweils gültigen Fassung) (die "Prospektverordnung") erfolgen:

- Qualifizierte Anleger: jederzeit an jede juristische Person, die ein qualifizierter Anleger im Sinne der Prospektverordnung ist;
- Weniger als 150 Angebotsempfänger: jederzeit an weniger als 150 natürliche oder juristische Personen (mit Ausnahme von qualifizierten Anlegern im Sinne der Prospektverordnung);
- ein Angebot von Produkten an Anleger, die Produkte für einen Gesamtpreis von mindestens EUR 100 000 pro Anleger für jedes separate Angebot erwerben; und/oder
- Sonstige Ausnahmeangebote: jederzeit und unter allen anderen Umständen, die unter Artikel 1 Absatz 4 der Prospektverordnung fallen, vorausgesetzt, dass ein solches Angebot von Produkten im Sinne der Buchstaben a) bis d) nicht die Veröffentlichung eines Prospekts gemäß Artikel 3 der Prospektverordnung oder das Nachtragen eines Prospekts gemäß Artikel 23 der Prospektverordnung erfordert.

Für die Zwecke dieser Bestimmung bedeutet der Ausdruck "öffentliches Angebot von Wertpapieren" in Bezug auf Produkte in jedem Mitgliedstaat eine Mitteilung in jedweder Form und auf jedwede Art und Weise von ausreichenden Informationen über die Angebotsbedingungen und die anzubietenden Produkte, um einen Anleger in die Lage zu versetzen, sich für den Kauf oder die Zeichnung der Produkte zu entscheiden.

Die vorgenannten Beschränkungen gelten nicht für die oben im Abschnitt "Öffentliches Angebot" unter "Allgemeine Informationen" genannten Rechtsordnungen.

Hongkong - Jeder Käufer gewährleistet und erklärt sich damit einverstanden, dass er weder in Hongkong noch anderenorts Werbematerialien, Aufforderungen oder sonstige Schriftstücke in Zusammenhang mit dem Produkt herausgegeben oder zwecks Herausgabe besessen hat bzw. herausgeben oder zwecks Herausgabe besitzen wird, die an die Öffentlichkeit in Hongkong gerichtet sind oder deren Inhalt wahrscheinlich der Öffentlichkeit in Hongkong zugänglich ist bzw. von ihr gelesen wird (außer soweit nach den Wertpapiergesetzen von Hongkong zulässig), es sei denn, es handelt sich um ein Produkt, das nur an Personen außerhalb von Hongkong oder an "professionelle Anleger" im Sinne der Securities and Futures Ordinance (Cap. 571) und sich daraus ergebenden Regeln verkauft wird oder verkauft werden soll.

Bei diesem Produkt handelt es sich um ein strukturiertes Produkt, das Derivate beinhaltet. Eine Anlage empfiehlt sich nur, wenn man das Produkt vollständig versteht und bereit ist, die damit verbundenen Risiken zu tragen. Wer sich über die mit einem Produkt verbundenen Risiken nicht im Klaren ist, sollte sich diese von seinem Anlageberater erklären lassen oder unabhängigen, professionellen Rat einholen.

Singapur - Dieses Dokument wurde nicht als Prospekt bei der Monetary Authority of Singapore zugelassen. Dementsprechend dürfen dieses Dokument und sonstige Dokumente oder Materialien im Zusammenhang mit dem Angebot oder Verkauf oder einer Aufforderung zu Zeichnung oder Kauf der Produkte in Singapur nicht öffentlich verbreitet und die Produkte Personen in Singapur nicht angeboten oder verkauft werden bzw. Gegenstand einer Aufforderung zu Zeichnung oder Kauf sein, weder direkt noch indirekt, es sei denn, bei dem Adressaten handelt es sich um (i) institutionelle Anleger (wie in Section 4A definiert) im Sinne von Section 274 des Singapore Securities and Futures Act (Chapter 289), in der jeweils gültigen Fassung, (die "SFA"), (ii) eine massgebliche Person (wie in Section 275(2) des SFA definiert) im Sinne von Section 275(1) oder um Personen im Sinne von Section 275(1A), die den Bedingungen von Section 275 des SFA und (gegebenenfalls) von Vorschrift 3 der Securities and Futures (Classes of Investors) Regulations 2018 genügen, oder (iii) sonstige Personen gemäss den Bedingungen weiterer anwendbarer SFA-Bestimmungen.

Werden die Produkte gemäss Section 275 des SFA von einer massgeblichen Person gezeichnet oder erworben und handelt es sich dabei um:

- eine Kapitalgesellschaft (die nicht als "Accredited Investor" gemäss Section 4A des SFA gilt), deren einzige Geschäftstätigkeit darin besteht, Vermögenswerte zu halten und deren gesamtes Aktienkapital sich im Besitz von einer oder mehreren natürlichen Personen befindet, die jeweils als "Accredited Investors" gelten; oder
- eine Treuhandgesellschaft (wobei der Treuhänder nicht als "Accredited Investor" gilt), deren einziger Zweck darin besteht, Vermögenswerte zu halten und deren Begünstigte allesamt "Accredited Investors" sind, so sind die Wertpapiere oder wertpapierbasierten Derivateverträge (jeweils in Section 2(1) des SFA definiert) dieser Kapitalgesellschaft oder die Rechte und Ansprüche der Begünstigten dieser Treuhandgesellschaft für einen Zeitraum von sechs Monaten nach dem Erwerb der Produkte durch die Kapitalgesellschaft oder die Treuhandgesellschaft aufgrund eines Angebots gemäss Section 275 des SFA nicht übertragbar, es sei denn:
 - es handelt sich um institutionelle Anleger oder massgebliche Personen im Sinne von Section 275(2) des SFA oder um sonstige Personen im Rahmen eines Angebots im Sinne von Section 275(1A) oder Section 276 (4)(i)(B) des SFA;
 - das Erbringen einer Gegenleistung für die Übertragung ist zu keinem Zeitpunkt vorgesehen;
 - die Übertragung erfolgt kraft Gesetzes;
 - wie in Section 276(7) des SFA bestimmt; oder
 - wie in Vorschrift 37A der Securities and Futures (Offers of Investments) (Securities and Securities-based Derivatives Contracts) Regulations 2018 festgelegt.

Gemäss Section 309B(1)(c) des SFA teilt die Emittentin den massgeblichen Personen (wie in SFA definiert) mit, dass die Produkte als "capital markets products other than prescribed capital markets products" (im Sinne des SFA und der Securities and Futures (Capital Markets Products) Regulations 2018) und "Specified Investment Products" (im Sinne der MAS Notice SFA 04-N12: Notice on the Sale of Investment Products und MAS Notice FAA-N16: Notice on Recommendations on Investment Products) eingestuft sind.

Vereinigtes Königreich - Ein öffentliches Angebot der Produkte im Vereinigten Königreich darf nur in Übereinstimmung mit den folgenden Ausnahmen erfolgen, die in der britischen Prospektverordnung und/oder im FSMA (falls zutreffend) festgelegt sind:

- (a) Qualifizierte Anleger: jederzeit an jede Person, die ein qualifizierter Anleger im Sinne der britischen Prospektverordnung ist;
- (b) weniger als 150 Zielempfänger: jederzeit an weniger als 150 natürliche oder juristische Personen (ausgenommen qualifizierte Anleger im Sinne der britischen Prospektverordnung);
- (c) andere freigestellte Angebote: jederzeit unter anderen Umständen, die unter Abschnitt 86 des FSMA fallen, vorausgesetzt, dass kein solches in Buchstabe (a) bis (c) oben genanntes Angebot eine Pflicht zur Veröffentlichung eines Prospekts gemäss Abschnitt 85 FSMA oder den Nachtrag eines Prospekts gemäss Artikel 23 der britischen Prospektverordnung erfordert.

Für die Zwecke der vorstehenden Bestimmungen bedeutet der Ausdruck "öffentliches Angebot von Produkten" in Bezug auf Produkte die Mitteilung ausreichender Informationen über die Bedingungen des Angebots und die anzubietenden Produkte in jeder Form und mit allen Mitteln, damit ein Anleger entscheiden kann, sich für den Kauf oder die Zeichnung der Produkte zu entscheiden; der Ausdruck "britische Prospektverordnung" bezeichnet die Verordnung (EU) 2017/1129, da sie gemäß dem European Union (Withdrawal) Act 2018 (in der jeweils gültigen Fassung) (die "EUWA") Teil des innerstaatlichen Rechts ist; und "FSMA" bezeichnet den Financial Services and Markets Act 2000.

USA - Dieses Produkt kann weder in den USA noch an US-Personen verkauft oder angeboten werden.