

**DIVIETO DI VENDITA AGLI INVESTITORI AL DETTAGLIO NEL REGNO UNITO – I Titoli non sono destinati ad essere offerti, venduti o altrimenti resi disponibili a e non dovrebbero essere offerti, venduti o altrimenti resi disponibili ad alcun investitore al dettaglio nel Regno Unito (UK). A tali fini, per investitore al dettaglio si intende un soggetto che sia uno (o più) dei seguenti: (i) un cliente al dettaglio, secondo la definizione di cui all'Articolo 2, punto (8), del Regolamento (UE) n. 2017/565, come facente parte del diritto interno in virtù dell'*European Union (Withdrawal) Act* del 2018 ("EUWA"); o (ii) un cliente ai sensi del *Financial Services and Markets Act* del 2000 (l'FSMA) e di qualsiasi norma o regolamento ai sensi dell'FSMA attuativo della Direttiva (UE) n. 2016/97, laddove tale cliente non si qualifichi come cliente professionale come definito al punto 8 dell'articolo 2(1) del Regolamento (UE) n. 600/2014, come facente parte del diritto nazionale in virtù dell'EUWA; o (iii) non un investitore qualificato, come definito nel Regolamento (UE) n. 2017/1129, come facente parte del diritto nazionale in virtù dell'EUWA. Di conseguenza, non è stato né sarà predisposto alcun documento contenente le informazioni chiave richieste dal Regolamento (UE) n. 1286/2014 come facente parte del diritto interno in virtù dell'EUWA (come modificato, il Regolamento PRIIPs UK) per l'offerta o la vendita dei Titoli o comunque per la loro messa a disposizione agli investitori al dettaglio in UK e pertanto l'offerta o la vendita dei Titoli o comunque la loro messa a disposizione a qualsiasi investitore al dettaglio in UK può essere illegale ai sensi del Regolamento PRIIPs UK.**

**GOVERNANCE DEI PRODOTTI MIFID II / INVESTITORI AL DETTAGLIO, INVESTITORI PROFESSIONALI E CONTROPARTI QUALIFICATE -** Ai soli fini del processo di approvazione del prodotto del produttore, la valutazione del mercato di riferimento in relazione ai Titoli, tenendo conto delle cinque categorie di cui al punto 19 degli Orientamenti pubblicati dalla *European Securities and Markets Authority* (ESMA) il 3 agosto 2023, ha portato alla conclusione che: (i) il mercato di riferimento per i Titoli è costituito da controparti qualificate, clienti professionali e clienti al dettaglio, ciascuno come definito nella MiFID II; e (ii) tutti i canali di distribuzione alle controparti qualificate e ai clienti professionali sono appropriati; e (iii) i seguenti canali di distribuzione dei Titoli ai clienti al dettaglio sono appropriati - servizi di consulenza in materia di investimenti, gestione di portafogli, vendite senza consulenza e mera esecuzione, nel rispetto degli obblighi di adeguatezza e appropriatezza del distributore ai sensi della MiFID II. Il prodotto è incompatibile con qualsiasi cliente al di fuori del mercato di riferimento positivo sopra identificato. Qualsiasi soggetto che successivamente offra, venda o raccomandi i Titoli (un distributore) dovrebbe prendere in considerazione la valutazione del mercato di riferimento del produttore; tuttavia, un distributore soggetto alla MiFID II è responsabile di intraprendere la propria valutazione del mercato di riferimento in relazione ai Titoli (adottando o perfezionando la valutazione del mercato di riferimento del produttore) e di determinare i canali di distribuzione appropriati, nel rispetto degli obblighi di adeguatezza e appropriatezza del distributore ai sensi della MiFID II, in quanto applicabili.

**GOVERNANCE DEI PRODOTTI MIFIR UK / MERCATO DI RIFERIMENTO SOLO INVESTITORI AL DETTAGLIO, INVESTITORI PROFESSIONALI E CONTROPARTI QUALIFICATE -** Ai soli fini del processo di approvazione del prodotto del produttore, la valutazione del mercato di riferimento in relazione ai Titoli, tenendo conto delle cinque categorie di cui al punto 18 degli Orientamenti pubblicati dalla *European Securities and Markets Authority* (ESMA) il 5 febbraio 2018 (in conformità con la dichiarazione politica della FCA intitolata "Brexit il nostro approccio al materiale non legislativo UE"), ha portato alla conclusione che: (i) il mercato di riferimento per i Titoli è costituito da clienti al dettaglio, come definiti all'articolo 2 punto (8) del Regolamento (UE) n. 2017/565 come facente parte del diritto interno in virtù dell'*European Union (Withdrawal) Act* del 2018 ("EUWA"), e da controparti qualificate, come definite nel Manuale FCA *Conduct of Business Sourcebook* ("COBS"), e da clienti professionali, come definiti nel Regolamento (UE) n. 600/2014 come facente parte del diritto interno in virtù dell'EUWA ("MiFIR UK"); (ii) tutti i canali di distribuzione alle controparti qualificate e ai clienti professionali sono appropriati; e (iii) i seguenti canali di distribuzione dei Titoli ai clienti al dettaglio sono appropriati - servizi di consulenza in materia di investimenti, gestione di portafogli, vendite senza consulenza e mera esecuzione, nel rispetto degli obblighi di adeguatezza e appropriatezza del distributore ai sensi del COBS, in quanto applicabili. Il prodotto è incompatibile con qualsiasi cliente al di fuori del mercato di riferimento positivo sopra identificato. Qualsiasi distributore dovrebbe prendere in considerazione la valutazione del mercato di riferimento del produttore; tuttavia, un distributore soggetto al Manuale FCA *Product Intervention e Product Governance Sourcebook* (le Regole per la Governance dei Prodotti MiFIR UK) è responsabile di intraprendere la propria valutazione del mercato di riferimento in relazione ai Titoli (adottando o perfezionando la valutazione del mercato di riferimento del produttore) e di determinare i canali di distribuzione appropriati, nel rispetto degli obblighi di adeguatezza e appropriatezza del distributore ai sensi del COBS, in quanto applicabili.

**VERSIONE FINALE APPROVATA DALL'EMITTENTE**

**Condizioni Definitive dell'8 gennaio 2024**



**Natixis Structured Issuance SA**

**Identificatore dell'entità giuridica (LEI): 549300YZ10WOWPBDW20**

**Programma di Emissione di Debito**

**da Euro 30.000.000.000**

**SERIE N.: 7798**

**TRANCHE NO: 1**

**Emissione di un massimo di EUR 20.000.000 di Certificati Strutturati (Phoenix) legati a un Paniere di Azioni con scadenza l'8 febbraio 2027**

**(i "Certificati")**

**Incondizionatamente e irrevocabilmente garantiti da NATIXIS**

**Ai sensi del Programma di Emissione di Debito**

**da Euro 30.000.000.000**

**Emessi da Natixis Structured Issuance SA (l'"Emittente")**

**NATIXIS in qualità di Dealer**

## PARTE A- CONDIZIONI CONTRATTUALI

I termini utilizzati nel presente documento si intendono definiti come tali ai fini del regolamento dei Certificati (il **Regolamento**) contenuto nel Prospetto di Base del 21 aprile 2023 e in qualsiasi supplemento al Prospetto di Base pubblicato e approvato alla o prima della data delle presenti Condizioni Definitive e di qualsiasi altro supplemento al Prospetto di Base che possa essere stato pubblicato e approvato prima della Data di Emissione (come di seguito definita) (il(i) **Supplemento(i)**) (fermo restando che, nella misura in cui un tale Supplemento (i) sia pubblicato e approvato successivamente alla data delle presenti Condizioni Definitive e (ii) preveda modifiche al Regolamento, tali modifiche non avranno alcun effetto rispetto al Regolamento dei Certificati cui si riferiscono le presenti Condizioni Definitive), che insieme costituiscono un prospetto di base ai fini del Regolamento Prospetti (il **Prospetto di Base**). Il presente documento costituisce le Condizioni Definitive dei Certificati qui descritti ai fini del Regolamento Prospetti e deve essere letto congiuntamente al Prospetto di Base al fine di ottenere tutte le informazioni rilevanti. Informazioni complete sull'Emittente e sull'emissione dei Certificati sono disponibili solo sulla base della lettura congiunta delle presenti Condizioni Definitive e del Prospetto di Base così integrato. Una sintesi dei Certificati è allegata alle presenti Condizioni Definitive. Il Prospetto di Base, ogni Supplemento al Prospetto di Base e le presenti Condizioni Definitive sono disponibili per la consultazione sul sito web della Borsa del Lussemburgo ([www.luxse.com](http://www.luxse.com)) e dell'Emittente (<https://cib.natixis.com/Home/pims/Prospectus#/prospectusPublic>) e possono essere richiesti in copia a NATIXIS, 7, promenade Germaine Sablon, 75013 Parigi, Francia.

- |   |       |  |   |
|---|-------|--|---|
| 1 | (i)   | Numero di Serie:   | 7798  |
|   | (ii)  | Numero di Tranche:   | 1   |
|   | (iii) | Data in cui i Titoli saranno consolidati e formeranno un'unica Serie con i Titoli esistenti: | Non Applicabile   |
| 2 |       | Valuta o Valute Specificate:   | Euro (" <b>EUR</b> ")   |
|   |       | Valuta di Sostituzione   | Dollaro USA (" <b>USD</b> ")  |
|   |       | Titoli CNY:  | Non Applicabile   |
| 3 |       | Importo Nominale Complessivo:  |   |
|   | (i)   | Serie:   | Fino a EUR 20.000.000 (equivalente a 20.000 Certificati). L'Importo Nominale Complessivo da emettere alla Data di Emissione sarà fissato al termine del periodo di offerta (come definito al successivo paragrafo 65) dopo la raccolta di tutte le sottoscrizioni. L'Emittente pubblicherà, non appena possibile dopo la determinazione di tale importo, un avviso che specifichi il rilevante Importo Nominale Complessivo così determinato. |
|   |       |  | Tale avviso potrà essere consultato sul sito web di NATIXIS<br><a href="https://cib.natixis.com/Home/pims/Prospectus#/prospectusPublic">/https://cib.natixis.com/Home/pims/Prospectus#/prospectusPublic</a> ).  |
|   | (ii)  | Tranche:   | Si veda la voce precedente  |
| 4 |       | Prezzo di Emissione:   | EUR 1.000 per Taglio Specificato  |
| 5 | (i)   | Taglio(i) Specificato(i):  | EUR 1.000   |
|   | (ii)  | Importo di Calcolo:  | EUR 1.000   |
| 6 | (i)   | Data di Emissione:   | 31 gennaio 2024   |

	(ii) Data di Decorrenza degli Interessi:	Non Applicabile
	(iii) Data del Trade:	21 dicembre 2023
7	Data di Scadenza:	8 febbraio 2027, soggetta alla Convenzione del Giorno Lavorativo ( <i>Business Day Convention</i> ), specificata al paragrafo 15(ii) che segue.
8	Stato dei Titoli:	Non Garantito
9	Base degli Interessi:	Come specificato al paragrafo 21 (Disposizioni per Titoli Strutturati) come completato dall'Allegato alle Condizioni Definitive in relazione al Regolamento Aggiuntivo dei Certificati. <i>(ulteriori dettagli specificati di seguito)</i>
10	Base di Rimborso/Pagamento:	Come specificato al paragrafo 21 (Disposizioni per Titoli Strutturati) come completato dall'Allegato alle Condizioni Definitive in relazione al Regolamento Aggiuntivo dei Certificati. <i>(ulteriori dettagli specificati di seguito)</i>
11	(i) Modifica della Base degli Interessi:	Non Applicabile
	(ii) Cambio della Base degli Interessi:	Non Applicabile
	(iii) Tasso di Interesse sugli importi scaduti dopo la Data di Scadenza o la data fissata per il rimborso anticipato:	Non Applicabile
12	Titoli con Interessi Suddivisi:	Non Applicabile
13	Gross-up Fiscale ( <i>Condizione 8 (Tassazione) del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e Condizione 8 del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese</i> ):	Applicabile
14	Opzioni Put/Call:	Non Applicabile
15	(i) <i>Day Count Fraction</i> :	Non Applicabile
	(ii) Convenzione del Giorno Lavorativo ( <i>Business Day Convention</i> ):	Convenzione del Giorno Lavorativo Successivo ( <i>Following Business Day Convention</i> )
	(iii) Centro(i) degli Affari ( <i>Condizione 5(k) del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e Condizione 5(k) del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese</i> ):	TARGET
16	Autorizzazioni societarie per l'emissione dei Titoli:	L'emissione dei Certificati è stata autorizzata da una delibera del consiglio di amministrazione dell'Emittente.
17	Metodo di distribuzione:	Non sindacato

**DISPOSIZIONI RELATIVE AGLI EVENTUALI INTERESSI E/O (NEL CASO DI TITOLI STRUTTURATI) AGLI IMPORTI DI RIMBORSO**

18	Disposizioni per i Titoli a Tasso Fisso	Non Applicabile
19	Disposizioni per i Titoli a Tasso Variabile:	Non Applicabile

20	Disposizioni per i Titoli Zero Coupon:	Non Applicabile
21	Disposizioni per i Titoli Strutturati:	Applicabile.  Gli Interessi e gli Importi di Rimborso saranno calcolati in base alla seguente formula: Titoli Legati ad Azioni: <b>Phoenix</b>  <i>(ulteriori dettagli sono specificati nell'Allegato alle presenti Condizioni Definitive)</i>
(i)	Disposizioni sugli Interessi:	Applicabile
(ii)	Data(e) del Periodo degli Interessi:	Non Applicabile
(iii)	Convenzione del Giorno Lavorativo ( <i>Business Day Convention</i> ) della Data del Periodo degli Interessi:	Non Applicabile
(iv)	Data(e) di Pagamento degli Interessi:	Si veda "Date di Pagamento" come indicate nell'Allegato alla voce Date di Pagamento, soggette alla Convenzione del Giorno Lavorativo ( <i>Business Day Convention</i> ) specificata nel precedente paragrafo 15(ii).
(v)	Prima Data di Pagamento degli Interessi:	Non Applicabile
(vi)	Parte responsabile del calcolo dell'Importo degli Interessi:	Agente di Calcolo
(vii)	Margine(i):	Non Applicabile
(viii)	Moltiplicatore del Tasso	Non Applicabile
(ix)	Date di Determinazione:	Non Applicabile

#### **ALTRE DISPOSIZIONI RELATIVE AI TITOLI STRUTTURATI**

22	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati ad Azioni (azione singola):	Non Applicabile
23	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati ad Indici (indice singolo):	Non Applicabile
24	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati ad Azioni (paniere di azioni):	Applicabile
(i)	Società:	Si veda la tabella di cui all'Allegato alla voce Sottostante.
(ii)	Azione(i):	Si veda la tabella di cui all'Allegato alla voce ISIN
(iii)	Paniere:	Si veda la tabella di cui all'Allegato alla voce Selezione.
(iv)	Performance del Paniere:	Non Applicabile
(v)	Ponderazione:	Si veda la tabella di cui all'Allegato alla voce Selezione.
(vi)	Borsa:	Si veda la definizione di cui alla Condizione 3(a) del Regolamento dei Titoli Strutturati.

(vii)	Borse Correlate:	Si veda la definizione di cui alla Condizione 3(a) del Regolamento dei Titoli Strutturati.
(viii)	Valutazione Separata:	Applicabile
(ix)	Numero di Azioni:	Due (2)
(x)	Condizioni Aggiuntive per le Nuove Azioni:	Non Applicabile
(xi)	Condizioni Aggiuntive per le Azioni Sostitutive:	Non Applicabile
(xii)	Prezzo Iniziale:	Indica il "Prezzo di Riferimento(i)", come indicato nell'Allegato.
(xiii)	Prezzo della Barriera:	Non Applicabile
(xiv)	Prezzo Finale:	Come definito nella Condizione 3(a) del Regolamento dei Titoli Strutturati.
(xv)	Performance delle Azioni:	Come indicato nell'Allegato
(xvi)	Evento Knock-in:	"meno di"
	a. Azione Knock-in:	Si veda la Condizione 3(d)(A) del Regolamento dei Titoli Strutturati.
	b. Prezzo Knock-in:	Indicato nell'Allegato sotto la voce B
	c. Data di Inizio del Periodo Knock-in:	La Data di Valutazione prevista per il 1° febbraio 2027
	d. Convenzione del Giorno di Negoziazione Programmato della Data di Inizio del Periodo Knock-in:	Applicabile
	e. Data di Termine del Periodo di Knock-in:	La Data di Valutazione prevista per il 1° febbraio 2027
	f. Convenzione del Giorno di Negoziazione Programmato della Data di Termine del Periodo di Knock-in:	Applicabile
	g. Orario di Valutazione Knock-in:	Indica l'Orario di Chiusura Programmato
	h. Numero di Azioni Knock-in	Si veda la Condizione 3(d)(A) del Regolamento dei Titoli Strutturati.
(xvii)	Evento Knock-out:	Non Applicabile
(xviii)	Evento di Rimborso Anticipato Automatico:	"maggiore o uguale a"
	a. Importo del Rimborso Anticipato Automatico:	Si veda la definizione di cui alla Condizione 3 del Regolamento dei Titoli Strutturati.

b.	Data(e) del Rimborso Anticipato Automatico:	Come da Allegato
c.	Prezzo del Rimborso Anticipato Automatico:	Indica una percentuale del Prezzo Iniziale corrispondente a R(t) nell'Allegato
d.	Tasso del Rimborso Anticipato Automatico:	Indica la somma del 100% e della Cedola <sub>3</sub> (t) come definita nell'Allegato
e.	Data(e) di Valutazione del Rimborso Anticipato Automatico:	Come da Allegato
f.	Date di Osservazione del Rimborso Anticipato Automatico:	Non Applicabile
g.	Prezzo delle Azioni:	Si veda la definizione di cui alla Condizione 3(e)(A) del Regolamento dei Titoli Strutturati.
h.	Numero di Azioni del Rimborso Anticipato Automatico:	Due (2)
(xix)	Range Accrual:	Non Applicabile
(xx)	Data di Strike:	31 gennaio 2024
(xxi)	Date di Osservazione:	Non Applicabile
(xxii)	Data(e) di Valutazione:	Si veda "Definizioni Comuni" riportate nell'Allegato
(xxiii)	Numero(i) Specifico(i):	Tre (3) Giorni di Negoziazione Programmati
(xxiv)	Orario di Valutazione:	Si veda la definizione di cui alla Condizione 3(a) del Regolamento dei Titoli Strutturati.
(xxv)	Rimborso mediante Consegna Fisica:	Non Applicabile
(xxvi)	Percentuale Minima:	Si veda la definizione di cui alla Condizione 3(f)(C)(1) del Regolamento dei Titoli Strutturati.
(xxvii)	Numero Limite:	Non Applicabile
(xxviii)	Tasso di Cambio:	Non Applicabile
(xxix)	Monetizzazione:	Non Applicabile
(xxx)	Modifica Normativa:	Applicabile
(xxxi)	Turbativa della Copertura:	Applicabile
(xxxii)	Aumento del Costo della Copertura:	Applicabile
(xxxiii)	Aumento del Costo del Prestito di Azioni:	Non Applicabile
(xxxiv)	Perdita del Prestito di Azioni:	Non Applicabile
(xxxv)	Rimborso Anticipato:	Applicabile

	(xxxvi) Cessazione del Servizio China Connect:	Non Applicabile
	(xxxvii) Esclusione delle Azioni China Connect:	Non Applicabile
25	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati ad Indici (paniere di indici):	Non Applicabile
26	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati a Materie Prime (singola materia prima):	Non Applicabile
27	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati a Materie Prime (paniere di materie prime):	Non Applicabile
28	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati a Fondi (singolo fondo):	Non Applicabile
29	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati a Fondi (paniere di fondi):	Non Applicabile
30	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati a Dividendi:	Non Applicabile
31	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati a Futures (singolo contratto Futures):	Non Applicabile
32	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati a Futures (Paniere(i) di contratti Futures):	Non Applicabile
33	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati a Crediti ( <i>Credit Linked</i> ):	Non Applicabile
34	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati ad Obbligazioni:	Non Applicabile
35	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati a Valute:	Non Applicabile
36	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati ad Inflazione:	Non Applicabile
37	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati a Warrant:	Non Applicabile
38	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati ad Azioni Privilegiate:	Non Applicabile
39	Disposizioni applicabili ai Titoli Legati a Tassi:	Non Applicabile
40	Disposizioni applicabili ai Titoli con Consegna Fisica:	Non Applicabile
41	Disposizioni applicabili ai Titoli Strutturati Ibridi:	Non Applicabile

**DISPOSIZIONI RELATIVE AL RIMBORSO DI TITOLI STRUTTURATI DIVERSI DAI TITOLI LEGATI A WARRANT, TITOLI LEGATI AD AZIONI PRIVILEGIATE E CERTIFICATI QUOTATI IN ITALIA**

- 42 Rimborso a Discrezione dell'Emittente: Non Applicabile
- 43 Rimborso a Discrezione dei Portatori dei Titoli: Non Applicabile
- 44 Importo di Rimborso Finale di ciascun Titolo: Un importo calcolato in conformità al Regolamento Aggiuntivo dei Certificati applicabile, come completato dall'Allegato alle Condizioni Definitive in relazione al Regolamento Aggiuntivo dei Certificati.
- (i) Soggetto responsabile del calcolo dell'Importo di Rimborso Finale e dell'Importo di Rimborso Anticipato (se non è l'Agente di Calcolo): Agente di Calcolo
- (ii) Disposizioni per la determinazione dell'Importo di Rimborso Finale se calcolato mediante riferimento all'Indice e/o alla Formula e/o ad altre variabili: Come da Allegato
- (iii) Disposizioni per la determinazione dell'Importo di Rimborso Finale nel caso in cui il calcolo mediante riferimento all'Indice e/o alla Formula e/o ad altre variabili sia impossibile o impraticabile o comunque oggetto di turbativa: Si veda il Regolamento
- (iv) Data di Pagamento: La Data di Scadenza
- (a) Importo nominale minimo potenzialmente pagabile a un Portatore di Titoli in relazione ad un Titolo: EUR 0,00 (zero)
- (b) Importo nominale massimo potenzialmente pagabile a un Portatore di Titoli in relazione ad un Titolo: EUR 1.000

#### **DISPOSIZIONI RELATIVE AL RIMBORSO ANTICIPATO**

##### **45 Importo di Rimborso Anticipato**

- (i) Importo(i) di Rimborso Anticipato di ciascun Titolo pagabile al momento del rimborso per motivi fiscali (*Condizione 6(b)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e *Condizione 6(b)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese), se applicabile, o al verificarsi di un Evento di Inadempimento (*Condizione 10 del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e Condizione 10 del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese*) o di un Evento di
- Come specificato nella *Condizione 5(k)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese.

Illegalità (*Condizione 6(c)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e *Condizione 6(c)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese):

- (ii) Il rimborso per motivi fiscali è consentito in qualsiasi giorno (compresi i giorni diversi dalle Date di Pagamento degli Interessi (*Condizione 6(b)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e *Condizione 6(b)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese)): Si
- (iii) Le Cedole Non Scadute diventeranno nulle al momento del rimborso anticipato (*Condizione 7(g)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese) Si
- (iv) Rimborso per illegalità (*Condizione 6(c)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e *Condizione 6(c)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese): Accordi di Copertura: Applicabile
- (v) Rimborso per Evento di Forza Maggiore ed Evento di Alterazione Significativa (*Condizione 6(m)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e *Condizione 6(k)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese):
  - (a) Evento di Forza Maggiore: Applicabile
  - (b) Evento di alterazione significativo: Non Applicabile
  - (c) Importo Protetto: Non Applicabile
- (vi) Rimborso anticipato laddove il Trigger Essenziale sia specificato come applicabile in relazione ai Titoli per i quali è specificato un Importo Protetto (*Condizione 6(n)(ii)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e *Condizione 6(l)(ii)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese): Non Applicabile
- (vii) Costi di Scioglimento (*Condizione 5(k)* del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e *Condizione 5(k)* del

Applicabile

*Regolamento dei Titoli di Diritto Francese):*

- |        |  |                 |
|--------|--|-----------------|
| (viii) | Rimborso Pro Rata Temporis (Condizione 5(k) del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e Condizione 5(k) del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese):                 | Non Applicabile |
| (ix)   | Trigger Essenziale (Condizione 11 del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e Condizione 14 del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese):                             | Non Applicabile |
| (x)    | Evento Trigger dell'Equo Valore di Mercato (Condizione 6(o) del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e Condizione 6(m) del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese): | Non Applicabile |
| (xi)   | Importo di Rimborso Anticipato dei Titoli Garantiti:   | Non Applicabile |
| (xii)  | Rimborso anticipato dei Titoli Legati a Garanzie:  | Non Applicabile |

**DISPOSIZIONI RELATIVE AL RIMBORSO RATEALE (RATE)**

- |    |                               |                 |
|----|-------------------------------|-----------------|
| 46 | Importo delle Rata:           | Non Applicabile |
| 47 | Importo delle Rata da Pagare: | Non Applicabile |
| 48 | Data(e) delle Rata:           | Non Applicabile |

**DISPOSIZIONI RELATIVE AL RIMBORSO DEI TITOLI LEGATI A WARRANT**

- |    |   |                 |
|----|---|-----------------|
| 49 | Importo di Rimborso Finale di ciascun Titolo  | Non Applicabile |
| 50 | Importo di Rimborso Anticipato (da calcolarsi in conformità alla Condizione 9 del Regolamento dei Titoli Strutturati) | Non Applicabile |
| 51 | Evento di Estinzione Anticipata dei Warrant   | Non Applicabile |

**DISPOSIZIONI RELATIVE AL RIMBORSO DEI TITOLI LEGATI AD AZIONI PRIVILEGIATE**

- |    |  |                 |
|----|--|-----------------|
| 52 | Rimborso dei Titoli Legati ad Azioni Privilegiate in conformità alla Condizione 19 del Regolamento dei Titoli Strutturati: | Non Applicabile |
| 53 | Rimborso Anticipato a seguito di un Evento Straordinario:  | Non Applicabile |
| 54 | Rimborso Anticipato a seguito di un Evento di Turbativa Aggiuntivo:  | Non Applicabile |

55 Rimborso Anticipato a seguito di un Evento di Estinzione Anticipata di Azioni Privilegiate: Non Applicabile

**DISPOSIZIONE APPLICABILE AI TITOLI NOMINATIVI AD IMPORTO DI EMISSIONE VARIABILE E AI TITOLI DISTRIBUITI/OFFERTI IN ITALIA**

56 Importo Minimo Trasferibile: Non Applicabile

**DISPOSIZIONI RELATIVE AI TITOLI GARANTITI**

57 Disposizioni per i Titoli garantiti: Non Applicabile

**DISPOSIZIONI GENERALI APPLICABILI AI TITOLI**

58 Forma dei Titoli: I Certificati sono Certificati Dematerializzati nel Sistema di Compensazione Italiano.

Titolo Globale Temporaneo o Permanente: Non Applicabile

Nuovo Titolo Globale: No

Certificati Globali: No

Agente di Registrazione: Non Applicabile

59 Ulteriore(i) Giurisdizione(i) del Giorno Lavorativo (*Condizione 7(i) del Regolamento dei Titoli di Diritto Inglese e Condizione 7(e) del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese*) o altre disposizioni speciali relative alle Date di Pagamento: TARGET

60 Cedole di Affogliamento per future Cedole o Ricevute da allegare ai Titoli Definitivi (e date di scadenza di tali Cedole di Affogliamento): No

61 Disposizioni sulla ridenominazione, rinominalizzazione e riconvenzione: Non Applicabile

62 Disposizioni sul Consolidamento: Si applicano le disposizioni della Condizione 13

63 Possibilità di detenere e rivendere i Titoli acquistati da Natixis in conformità alle leggi e ai regolamenti applicabili

(Condizione 6(d)): Applicabile

64 Disposizioni sulla Doppia Valuta: Non Applicabile

65 Termini e Condizioni dell'Offerta: Applicabile

Prezzo di Offerta: EUR 1.000 per Taglio Specificato, equivalente al 100% dell'Importo Nominale Complessivo.

Condizioni a cui è soggetta l'offerta:

I Certificati saranno offerti in Italia sulla base di un'offerta pubblica

Prima della Data di Emissione non è possibile effettuare alcuna negoziazione dei Certificati che saranno offerti al pubblico in Italia.

L'Emittente determinerà a sua esclusiva discrezione l'ammontare finale dei Certificati emessi fino ad un limite di EUR 20.000.000,00. L'importo finale emesso alla Data di Emissione sarà quotato sul Mercato dei *Securitized Derivatives* (il "**SeDeX**"), organizzato e gestito da Borsa Italiana S.p.A. L'importo finale dei Certificati emessi sarà determinato dall'Emittente alla luce delle condizioni di mercato prevalenti, e a sua unica e assoluta discrezione, in funzione del numero di Certificati che sono stati prenotati per l'acquisto alla Data di Emissione.

Il Periodo di Offerta potrà essere chiuso anticipatamente secondo quanto stabilito dall'Emittente a sua esclusiva discrezione e notificato alla o in prossimità di tale data anticipata mediante pubblicazione sul sito internet di NATIXIS (<https://cib.natixis.com/Home/pims/Prospectus#/prospectusPublic>).

L'Emittente si riserva il diritto di prorogare il Periodo di Offerta. L'Emittente renderà nota la proroga del Periodo di Offerta mediante avviso da pubblicarsi sul sito internet di NATIXIS (<https://cib.natixis.com/Home/pims/Prospectus#/prospectusPublic>).

L'Emittente si riserva il diritto di aumentare il numero di Certificati da emettere durante il Periodo di Offerta. L'Emittente informerà il pubblico dell'aumento del numero di Certificati mediante avviso che sarà pubblicato sul sito web di NATIXIS (<https://cib.natixis.com/Home/pims/Prospectus#/prospectusPublic>).

Il periodo di tempo, comprese eventuali modifiche, durante il quale l'offerta sarà aperta e descrizione del processo di adesione:

L'offerta dei Certificati inizierà alle ore 9.00 (CET) del 10 gennaio 2024 e terminerà alle ore 17.30 (CET) del 29 gennaio 2024 (il **Periodo di Offerta**) o nel diverso orario della diversa data precedente eventualmente deciso dall'Emittente a sua esclusiva e assoluta discrezione alla luce delle condizioni di mercato prevalenti.

Gli investitori possono fare domanda di sottoscrizione dei Certificati durante il Periodo di Offerta. Il Periodo di Offerta può essere interrotto in qualsiasi momento. In tal caso, l'offerente ne darà immediata comunicazione al pubblico prima della fine del Periodo di Offerta mediante un avviso pubblicato sul

sito web di NATIXIS  
(<https://cib.natixis.com/Home/pims/Prospectus#/prospectusPublic>).

Qualsiasi domanda dovrà essere presentata in Italia ai collocatori. L'attività di distribuzione sarà svolta secondo le consuete procedure del collocatore. Gli investitori non saranno tenuti a stipulare alcun accordo contrattuale relativo alla sottoscrizione dei Certificati direttamente con l'Emittente.

Chiunque desideri sottoscrivere i Certificati è tenuto a compilare completamente e firmare correttamente un ordine di sottoscrizione e a presentarlo al collocatore.

Il collocatore, in accordo con l'Emittente e il Dealer, ha il diritto di accettare o rifiutare gli ordini di sottoscrizione, sia parzialmente sia completamente, o di chiudere l'offerta o di estendere il periodo dell'offerta, indipendentemente dalla circostanza che il volume previsto dei Certificati da collocare sia stato raggiunto o meno. Né l'Emittente, né il collocatore o il Dealer sono tenuti a motivare tale decisione.

Un potenziale investitore deve contattare il rilevante collocatore prima della fine del Periodo di Offerta. Un potenziale investitore sottoscriverà i Certificati in conformità alle disposizioni concordate con il rilevante collocatore in merito alla sottoscrizione di certificati in generale.

L'offerta dei Certificati è subordinata alla loro emissione.

Non esistono criteri di assegnazione predefiniti. I collocatori adotteranno criteri di assegnazione che garantiscano la parità di trattamento dei potenziali investitori. Tutti i Certificati richiesti tramite i collocatori durante il Periodo di Offerta saranno assegnati fino all'importo massimo dell'offerta. Un potenziale investitore riceverà, alla Data di Emissione, il 100% dell'importo dei Certificati assegnatigli durante il Periodo di Offerta.

I Certificati sono compensati attraverso i sistemi di compensazione e devono essere consegnati attraverso il collocatore alla o in prossimità della Data di Emissione.

Ai fini dell'offerta nella Repubblica Italiana, il sistema di compensazione sarà Monte Titoli S.p.A., noto anche come Euronext Securities Milan, che effettuerà il regolamento.

Per il Prezzo di Offerta che include le commissioni pagabili al collocatore si veda sopra "*Prezzo di Offerta*".

Dettagli sull'importo minimo e/o massimo della richiesta e descrizione della procedura di adesione:

L'importo minimo della richiesta è di un (1) Certificato del Taglio Specificato.

Descrizione della possibilità di ridurre le sottoscrizioni e delle modalità di rimborso dell'importo pagato in eccesso dai richiedenti: L'Emittente ha il diritto di annullare l'emissione dei Certificati per qualsiasi motivo. In tal caso, l'Emittente non è tenuto a fornire alcuna motivazione.

Dettagli sulle modalità e sui termini di pagamento e consegna dei titoli: Consegna a fronte di pagamento

Modalità e data di pubblicazione dei risultati dell'offerta: L'Emittente pubblicherà, non appena possibile dopo la fine del periodo di offerta, un Avviso che specificherà il numero di Certificati da emettere. Tale Avviso può essere consultato sul sito web di NATIXIS (<https://cib.natixis.com/Home/pims/Prospectus#/prospectusPublic>).

Procedura per l'esercizio di qualsiasi diritto di prelazione, negoziabilità dei diritti di sottoscrizione e trattamento dei diritti di sottoscrizione non esercitati: Non Applicabile

La circostanza che sono state riservate delle tranche a determinati paesi: Non Applicabile

Procedura di notifica ai richiedenti dell'importo assegnato e indicazione della possibilità di iniziare le negoziazioni prima della notifica: Non Applicabile

Importo delle spese e delle imposte specificamente addebitate al sottoscrittore o all'acquirente: Non Applicabile

Nome(i) e indirizzo(i), per quanto noto all'Emittente, dei collocatori nei vari paesi in cui ha luogo l'offerta: Gli Offerenti Autorizzati identificati nel successivo paragrafo 71 e individuabili dal Prospetto di Base

Nome e indirizzo dei soggetti che hanno un impegno irrevocabile ad agire in qualità di intermediari nelle negoziazioni sul secondario, fornendo liquidità attraverso quotazioni denaro e lettera e descrizione dei principali termini del loro impegno: Non Applicabile

## **DISPOSIZIONI SUI BENCHMARK**

66 Amministratore del Benchmark: Non Applicabile

### **DISTRIBUZIONE**

67 (i) Se sindacata, nomi e indirizzi dei Manager e impegni di sottoscrizione: Non Applicabile

(ii) Data dell'Accordo di Sottoscrizione: Non Applicabile

(iii) Responsabile(i) della Stabilizzazione (se presente): Non Applicabile

68	Se non sindacata, nome e indirizzo del Dealer:	<p>Il seguente Dealer sottoscrive i Certificati:</p> <p>NATIXIS</p> <p>7, promenade Germaine Sablon</p> <p>75013 Parigi, Francia</p> <p>A scanso di equivoci, il Dealer non agirà in qualità di collocatore.</p> <p>Natixis è il Responsabile del Collocamento ai sensi dell'articolo 93-<i>bis</i> del Decreto Legislativo del 24 febbraio 1998, n. 58, come successivamente modificato (il <b>Testo Unico della Finanza</b>), in relazione all'offerta pubblica in Italia in quanto ha organizzato il consorzio di collocamento nominando i collocatori. A scanso di equivoci, il Responsabile del Collocamento non agirà in qualità di collocatore e non collegherà i Certificati in Italia.</p>
69	Nome e indirizzo degli agenti aggiuntivi nominati in relazione ai Titoli:	<p>Agente di calcolo:</p> <p>NATIXIS</p> <p>Dipartimento Agente di Calcolo</p> <p>7, promenade Germaine Sablon</p> <p>75013 Parigi, Francia</p> <p><b><u>Agente per l'Emissione e i Pagamenti:</u></b></p> <p>BNP Paribas, Succursale Italia (il Soggetto Incaricato dei Pagamenti in Italia)</p> <p>Piazza Lina Bo Bardi 3, 20124 Milano, Italia</p>
70	Commissioni e concessioni totali:	Non Applicabile
71	Offerta Non Esente	Applicabile
	Giurisdizioni dell'Offerta Non Esente:	Italia
	Periodo di Offerta:	L'offerta dei Certificati inizierà alle 9:00 (CET) del 10 gennaio 2024 fino alle 17:30 (CET) del 29 gennaio 2024.
	Intermediari finanziari a cui è stato concesso un consenso specifico all'utilizzo del Prospetto di Base in conformità al Regolamento in esso contenuto:	<p>Banco di Desio e della Brianza</p> <p>Via Rovagnati, 1</p> <p>20832 Desio (MB) (l'"<b>Offerente Autorizzato</b>" o il "<b>Collocatore</b>")</p>
	Consenso Generale:	Non Applicabile
	Altri Termini dell'Offerente Autorizzato:	<p>I Certificati saranno offerti nella Repubblica Italiana sulla base di un'offerta pubblica</p> <p>A tali fini, è stato richiesto alla <i>Commission de Surveillance du Secteur Financier</i> (CSSF) di fornire all'autorità competente nella Repubblica Italiana, la Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB), un certificato di approvazione che attesti che il Prospetto di Base è stato redatto in conformità al</p>

Regolamento Prospetti e alle rilevanti misure attuative in Lussemburgo ai fini dell'offerta dei Certificati nella Repubblica Italiana. Il Prospetto di Base è stato passaportato, *inter alia*, nella Repubblica Italiana in conformità all'articolo 25, paragrafo 1, del Regolamento Prospetti. Inoltre, l'Emittente si riserva il diritto di richiedere alla CSSF, per alcuni paesi dello Spazio Economico Europeo (SEE), un certificato di approvazione del presente Prospetto di Base ai sensi dell'articolo 25(1) del Regolamento Prospetti, al fine di poter offrire al pubblico i Certificati anche in tali paesi e/o di ottenerne l'ammissione alla negoziazione in un mercato organizzato (ai sensi della Direttiva 2014/65/UE e successive modifiche) (il Passaporto SEE). Non è stato ottenuto alcun permesso speciale che consenta l'offerta dei Certificati o la distribuzione del prospetto in una giurisdizione al di fuori dei paesi per i quali un Passaporto SEE è possibile e un permesso necessario. L'Emittente può, a sua esclusiva discrezione, decidere di volta in volta di notificare il presente Prospetto di Base ad altri Stati SEE.

Offerta Non Esente:

Un'offerta dei Certificati può essere effettuata, oltre che ai sensi dell'articolo 1(4) e/o 3(2) del Regolamento Prospetti, nella Repubblica Italiana (la **Giurisdizione dell'Offerta Pubblica**) durante il Periodo di Offerta nelle ore in cui le banche sono generalmente aperte per gli affari in Italia.

I Certificati possono essere offerti solo in conformità alle leggi e ai regolamenti applicabili e, in particolare, ai sensi degli articoli 21, 25 e 31 del Regolamento Prospetti e in conformità alle presenti Condizioni Definitive.

I Certificati collocati attraverso offerta fuori sede ai sensi dell'articolo 30 del Decreto Legislativo del 24 febbraio 1998, n. 58, come successivamente modificato (il **Testo Unico della Finanza**) saranno offerti nel periodo compreso tra il 10 gennaio 2024, incluso, e il 22 gennaio 2024, incluso, fatta salva l'eventuale chiusura anticipata o estensione del Periodo di Offerta. Ai sensi dell'articolo 30, comma 6, del Testo Unico della Finanza, la validità e l'efficacia dei contratti stipulati mediante offerta fuori sede sono sospese per un periodo di sette giorni dalla sottoscrizione dei medesimi da parte degli investitori. Entro tale periodo l'investitore può comunicare il proprio recesso al collocatore senza alcun onere o commissione.

I Certificati saranno distribuiti da Banco di Desio e della Brianza S.p.A. anche mediante tecniche di comunicazione a distanza ai sensi dell'articolo 32 del Testo Unico della Finanza, a partire dal 10 gennaio 2024, incluso, e fino al 15 gennaio 2024, incluso. In questo caso, l'investitore potrà acquistare i Certificati, previa identificazione da parte del Collocatore,

utilizzando la propria password/codice identificativo personale.

Pubblicazione degli avvisi relativi all'Offerta:

Tutti gli avvisi da pubblicare secondo quanto specificato nel presente documento saranno preparati, rispettivamente, da o per conto dell'Emittente o del collocatore e pubblicati come segue:

dall'Emittente in inglese e in italiano sul proprio sito web

(<https://cib.natixis.com/Home/pims/Prospectus#/prospectusPublic>)

## GENERALE

- |    |   |  |
|----|---|--|
| 72 | Esenzione TEFRA applicabile:  | Non Applicabile  |
| 73 | Ulteriori considerazioni sull'imposta federale sul reddito degli Stati Uniti: | I Certificati non sono Titoli Specificati (come definiti nel Prospetto di Base) ai fini della Sezione 871(m) dell' <i>U.S. Internal Revenue Code</i> del 1986. |
| 74 | Masse (Condizione 11 del Regolamento dei Titoli di Diritto Francese):         | Non Applicabile  |
| 75 | Legge applicabile:  | Diritto inglese  |

## VERSIONE FINALE APPROVATA DALL'EMITTENTE

## PARTE B- ALTRE INFORMAZIONI

### 1 QUOTAZIONE E AMMISSIONE ALLA NEGOZIAZIONE

- (i) Quotazione: Mercato dei Securitised Derivatives (il "SeDeX"), organizzato e gestito da Borsa Italiana S.p.A.
- (ii) Ammissione alla negoziazione: Sarà presentata domanda di quotazione dei Certificati sulla Borsa Italiana e di ammissione dei Certificati alla negoziazione sul SeDeX con effetto dalla Data di Emissione.
- (iii) Prima data in cui i Titoli saranno ammessi alla negoziazione: La Data di Emissione
- (iv) Stima delle spese totali relative all'ammissione alla negoziazione: EUR 3.000
- (v) Mercati regolamentati o mercati equivalenti sui quali, per quanto a conoscenza dell'emittente, sono già ammessi alla negoziazione titoli della stessa classe dei titoli da offrire o da ammettere alla negoziazione: Non Applicabile

### 2 RATING

Rating: I Titoli da emettersi non hanno ricevuto rating

### 3 NOTIFICA

La *Commission de Surveillance du Secteur Financier* del Lussemburgo ha fornito alle competenti autorità in Belgio, Repubblica Ceca, Danimarca, Finlandia, Francia, Germania, Irlanda, Italia, Paesi Bassi, Norvegia, Polonia, Portogallo, Spagna e Svezia un certificato di approvazione che attesta che il Prospetto di Base è stato redatto in conformità al Regolamento Prospetti.

### 4 INTERESSI DI PERSONE FISICHE E GIURIDICHE COINVOLTE NELL'EMISSIONE

È possibile che Natixis paghi una commissione al Collocatore. La commissione è calcolata prendendo la commissione percentuale annua e moltiplicandola per la durata (in anni) dei Certificati. La commissione percentuale annua sarà pari a un massimo dello 0,91% (tasse incluse) del valore nominale. La commissione viene pagata alla Data di Emissione. Ulteriori dettagli sull'elemento commissione sono disponibili su richiesta.

L'acquirente o, se del caso, il broker che presenta questi titoli riconosce e accetta di comunicare integralmente ai propri clienti l'esistenza, la natura e l'importo di qualsiasi commissione o onorario ad esso pagato o pagabile da Natixis (anche, se del caso, a titolo di sconto) secondo quanto richiesto in conformità alle leggi e ai regolamenti ad esso applicabili, compresa qualsiasi normativa, regolamento e/o norma di attuazione della Direttiva sui Mercati degli Strumenti Finanziari (2014/65/UE) (MiFID II), o secondo quanto altrimenti applicabile in giurisdizioni non appartenenti al SEE.

### 5 RAGIONI DELL'EMISSIONE, STIMA DEI PROVENTI NETTI E DELLE SPESE TOTALI

- (i) Ragioni dell'emissione: Come specificato nella sezione del Prospetto di Base intitolata "*Utilizzo dei proventi*".
- (ii) Stima dei proventi netti: I proventi netti dell'emissione dei Certificati saranno pari al 100% dell'Importo Nominale Complessivo dei Certificati ammessi alla negoziazione.

(iii) Stima delle spese totali: Ad eccezione della stima delle commissioni di quotazione e delle commissioni di licenza dell'indice, alla Data di Emissione non è possibile determinare altre spese.

## 6 Solo Titoli a Tasso fisso - RENDIMENTO

Indicazione del rendimento: Non Applicabile

## 7 INFORMAZIONI RELATIVE AL SOTTOSTANTE

Il prezzo d'esercizio o il prezzo di riferimento finale del sottostante Si veda l'Allegato alle Condizioni Definitive in relazione al Regolamento Aggiuntivo dei Certificati.

Un'indicazione sul luogo in cui è possibile ottenere informazioni sulla performance passata e futura del sottostante e sulla sua volatilità. Si veda la rilevante pagina Bloomberg del Sottostante, come indicata nell'Allegato alla voce Codice Bloomberg su [www.bloomberg.com](http://www.bloomberg.com).  
Queste informazioni possono essere ottenute gratuitamente.

Se il sottostante è un titolo: Non Applicabile

Se il sottostante è un indice: Applicabile

(i) il nome dell'indice: Si veda la tabella di cui all'Allegato alla voce "Sottostante".

(ii) se l'indice non è composto dall'Emittente, il luogo in cui è possibile ottenere informazioni sull'indice: Si veda la tabella di cui all'Allegato

Se il sottostante è un tasso di interesse, una descrizione del tasso di interesse: Non Applicabile

## 8 COLLOCAMENTO E SOTTOSCRIZIONE

Nome e indirizzo del(i) coordinatore(i) dell'offerta globale e delle singole parti dell'offerta: Non Applicabile

Nome e indirizzo degli agenti per i pagamenti e degli agenti depositari in ciascun paese (oltre all'Agente Principale per i Pagamenti): Non Applicabile

Nomi e indirizzi dei soggetti che accettano di sottoscrivere l'emissione sulla base di un impegno irrevocabile e dei soggetti che accettano di collocare l'emissione senza un impegno irrevocabile o con accordi di "best effort": Non Applicabile

Se è stato o sarà raggiunto l'accordo di sottoscrizione: Non Applicabile

Divieto di vendita agli investitori al dettaglio del SEE: Non Applicabile

Divieto di vendita agli investitori al dettaglio del Regno Unito: Applicabile

## 9 INFORMAZIONI AGGIUNTIVE IN RELAZIONE AI CONSULENTI

Consulenti

Non Applicabile

**10 CODICE DI CONDOTTA DI HONG KONG SFC** Non Applicabile

**11 INFORMAZIONI OPERATIVE**

Destinati a essere detenuti in modo da consentire l'idoneità all'Eurosistema:

No. Sebbene la designazione sia specificata come "no" alla data delle presenti Condizioni Definitive, qualora i criteri di idoneità dell'Eurosistema vengano modificati in futuro in modo tale che i Certificati siano in grado di soddisfarli, i Certificati potranno essere depositati presso uno degli ICSD come custode comune. Si noti che ciò non significa necessariamente che i Certificati saranno riconosciuti come garanzia idonea per la politica monetaria dell'Eurosistema e per le operazioni di credito infragiornaliere da parte dell'Eurosistema in qualsiasi momento della loro vita. Tale riconoscimento dipenderà dalla circostanza che la BCE abbia accertato il rispetto dei criteri di idoneità dell'Eurosistema.

Codice ISIN:

IT0006761669

Common Code:

274181311

CFI:

DEEVRB

FISN:

NATIXIS STR ISS/TS INV CRT

Depositari:

(i) Euroclear France in qualità di Depositario Centrale:

No

(ii) Depositario comune per Euroclear e Clearstream:

No

Eventuale/i sistema/i di compensazione diverso/i da Euroclear e Clearstream e il/i relativo/i numero/i di identificazione:

Monte Titoli S.p.A., nota anche come Euronext Securities Milano, Piazza degli Affari 6, 20123 Milano, Italia

Consegna:

Consegna a fronte di pagamento

Nomi e indirizzi degli Agenti aggiuntivi nominati in relazione ai Titoli (se presenti):

BNP Paribas, Succursale Italia (il Soggetto Incaricato dei Pagamenti in Italia)  
Piazza Lina Bo Bardi 3, 20124 Milano, Italia

**12 INFORMAZIONI POST-EMISSIONE RELATIVE AL SOTTOSTANTE**

L'Emittente non fornirà alcuna informazione relativa al sottostante.

## ALLEGATO ALLE CONDIZIONI DEFINITIVE IN RELAZIONE AL REGOLAMENTO AGGIUNTIVO DEI CERTIFICATI

*Le informazioni riportate nel presente Allegato consolidano le informazioni già citate nelle Condizioni Aggiuntive e sono incluse per favorire la comprensibilità del prodotto.*

- 1. Disposizioni applicabili ai Titoli Strutturati (ad eccezione dei Titoli Legati a Tassi, dei Titoli Legati a Valute, dei Titoli Legati a Crediti (*Credit Linked*), dei Titoli Legati ad Obbligazioni, dei Titoli Legati ad Inflazione e dei Titoli Strutturati Ibridi) relative alle formule per il calcolo degli Interessi, dell'Importo di Rimborso Finale e/o dell'Importo di Rimborso Opzionale e/o dell'Importo di Rimborso Anticipato Automatico**

### 1.1 Definizioni Comuni

#### Date di Valutazione/ Date di Valutazione del Rimborso Anticipato Automatico

T	Date di Valutazione / Date di Valutazione del Rimborso Anticipato Automatico
1	29 febbraio 2024
2	2 aprile 2024
3	30 aprile 2024
4	31 maggio 2024
5	1 luglio 2024
6	31 luglio 2024
7	2 settembre 2024
8	30 settembre 2024
9	31 ottobre 2024
10	2 dicembre 2024
11	2 gennaio 2025
12	31 gennaio 2025
13	28 febbraio 2025
14	31 marzo 2025
15	30 aprile 2025
16	2 giugno 2025
17	30 giugno 2025
18	31 luglio 2025
19	1 settembre 2025
20	30 settembre 2025
21	31 ottobre 2025
22	1 dicembre 2025

23	2 gennaio 2026
24	2 febbraio 2026
25	2 marzo 2026
26	31 marzo 2026
27	30 aprile 2026
28	1 giugno 2026
29	30 giugno 2026
30	31 luglio 2026
31	31 agosto 2026
32	30 settembre 2026
33	2 novembre 2026
34	30 novembre 2026
35	4 gennaio 2027
36	1 febbraio 2027

**Date di Pagamento / Date del Rimborso Anticipato Automatico:**

<b>T</b>	<b>Date di Pagamento / Date del Rimborso Anticipato Automatico</b>
1	7 marzo 2024
2	9 aprile 2024
3	8 maggio 2024
4	7 giugno 2024
5	8 luglio 2024
6	7 agosto 2024
7	9 settembre 2024
8	7 ottobre 2024
9	7 novembre 2024
10	9 dicembre 2024
11	9 gennaio 2025
12	7 febbraio 2025
13	7 marzo 2025
14	7 aprile 2025
15	8 maggio 2025
16	9 giugno 2025
17	7 luglio 2025
18	7 agosto 2025

19	8 settembre 2025
20	7 ottobre 2025
21	7 novembre 2025
22	8 dicembre 2025
23	9 gennaio 2026
24	9 febbraio 2026
25	9 marzo 2026
26	9 aprile 2026
27	8 maggio 2026
28	8 giugno 2026
29	7 luglio 2026
30	7 agosto 2026
31	7 settembre 2026
32	7 ottobre 2026
33	9 novembre 2026
34	7 dicembre 2026
35	11 gennaio 2027
36	8 febbraio 2027

**Date di Osservazione** è Non Applicabile.

**Selezione** indica:

<b>i</b>	<b>Sottostante</b>	<b>Codice ISIN</b>	<b>Codice Bloomberg</b>	<b>Ponderazione "W<sub>i</sub>"</b>
1	Intesa Sanpaolo SpA	IT0000072618	ISP IM	100%
2	Societe Generale SA	FR0000130809	GLE FP	100%

**Prezzo di Riferimento(i)** indica il Prezzo Iniziale

<b>i</b>	<b>Prezzo di Riferimento</b>
1	Prezzo di Strike - Si veda la definizione di Prezzo Iniziale nella Condizione 3 (a)(A) del Regolamento dei Titoli Strutturati.
2	Prezzo di Strike - Si veda la definizione di Prezzo Iniziale nella Condizione 3 (a)(A) del Regolamento dei Titoli Strutturati.

**Effetto Memoria** è Non Applicabile

**Prezzo** indica Prezzo Finale

**Insieme delle Date di Osservazione della Media** è Non Applicabile

Insieme delle Date di Osservazione Lookback è Non Applicabile  
Insieme 1 delle Date di Osservazione è Non Applicabile  
Insieme 2 delle Date di Osservazione è Non Applicabile  
Insieme delle Date di Osservazione Attuariali è Non Applicabile  
Insieme delle Date di Osservazione dei Prezzi è Non Applicabile

## 1.2 Phoenix

Applicabile

### Elementi per il calcolo della Cedola:

Cedola<sub>1</sub> (t) indica, per ciascuna Data di Valutazione con indice "t", con "t" che va da 1 a 36:

t	Cedola <sub>1</sub> (t)
1	0,7800%
2	0,7800%
3	0,7800%
4	0,7800%
5	0,7800%
6	0,7800%
7	0,7800%
8	0,7800%
9	0,7800%
10	0,7800%
11	0,7800%
12	0,7800%
13	0,7800%
14	0,7800%
15	0,7800%
16	0,7800%
17	0,7800%

18	0,7800%
19	0,7800%
20	0,7800%
21	0,7800%
22	0,7800%
23	0,7800%
24	0,7800%
25	0,7800%
26	0,7800%
27	0,7800%
28	0,7800%
29	0,7800%
30	0,7800%
31	0,7800%
32	0,7800%
33	0,7800%
34	0,7800%
35	0,7800%
36	0,7800%

**Cedola<sub>2</sub> (t)** indica, per ciascuna Data di Valutazione con indice "t", con "t" che va da 1 a 36:

<b>t</b>	<b>Cedola<sub>2</sub> (t)</b>
1	0,0000%
2	0,0000%

3	0,0000%
4	0,0000%
5	0,0000%
6	0,0000%
7	0,0000%
8	0,0000%
9	0,0000%
10	0,0000%
11	0,0000%
12	0,0000%
13	0,0000%
14	0,0000%
15	0,0000%
16	0,0000%
17	0,0000%
18	0,0000%
19	0,0000%
20	0,0000%
21	0,0000%
22	0,0000%
23	0,0000%
24	0,0000%

25	0,0000%
26	0,0000%
27	0,0000%
28	0,0000%
29	0,0000%
30	0,0000%
31	0,0000%
32	0,0000%
33	0,0000%
34	0,0000%
35	0,0000%
36	0,0000%

**H(t)** indica, per ciascuna Data di Valutazione con indice "t", con "t" che va da 1 a 36:

<b>t</b>	<b>H(t)</b>
1	Non Applicabile
2	Non Applicabile
3	Non Applicabile
4	Non Applicabile
5	Non Applicabile
6	Non Applicabile
7	Non Applicabile
8	Non Applicabile
9	Non Applicabile
10	Non Applicabile
11	Non Applicabile
12	Non Applicabile
13	Non Applicabile
14	Non Applicabile
15	Non Applicabile
16	Non Applicabile
17	Non Applicabile
18	Non Applicabile
19	Non Applicabile
20	Non Applicabile
21	Non Applicabile

22	Non Applicabile
23	Non Applicabile
24	Non Applicabile
25	Non Applicabile
26	Non Applicabile
27	Non Applicabile
28	Non Applicabile
29	Non Applicabile
30	Non Applicabile
31	Non Applicabile
32	Non Applicabile
33	Non Applicabile
34	Non Applicabile
35	Non Applicabile
36	Non Applicabile

**PerfPaniere<sub>i</sub>(t)**

**PerfPaniere<sub>i</sub>(t)** indica, per ciascuna Data di Valutazione con indice "t", con "t" che va da 1 a 36, la formula della **Performance Locale**.

La formula della **Performance Locale** indica, per ciascuna Data di Valutazione con indice "t", con "t" che va da 1 a 36, la formula *Worst Of*.

In ogni formula *Worst Of*, **PerfIndiv(i,t)** indica, per ciascuna Data di Valutazione con indice "t", con "t" che va da 1 a 36, la formula della **Performance Individuale Europea**.

In ogni formula della **Performance Individuale Europea**, **Prezzo(i, t)** indica, per ciascuna Data di Valutazione con indice "t", con "t" che va da 1 a 36, il **Prezzo** del Sottostante con indice "i", con "i" che va da 1 a 2, in tale Data di Valutazione.

**Elementi per il calcolo dell'Importo del Rimborso Anticipato Automatico:**

**R(t)** indica, per ciascuna Data di Valutazione con indice "t", con "t" che va da 1 a 36:

<b>t</b>	<b>R(t)</b>
1	Non Applicabile
2	Non Applicabile
3	Non Applicabile
4	Non Applicabile
5	Non Applicabile
6	Non Applicabile
7	Non Applicabile
8	Non Applicabile
9	100,0000 %
10	100,0000 %
11	100,0000 %
12	100,0000 %
13	100,0000 %
14	100,0000 %
15	95,0000 %
16	95,0000 %
17	95,0000 %
18	95,0000 %
19	95,0000 %
20	95,0000 %
21	90,0000 %
22	90,0000 %
23	90,0000 %
24	90,0000 %
25	90,0000 %
26	90,0000 %
27	85,0000 %
28	85,0000 %
29	85,0000 %
30	85,0000 %

31	85,0000 %
32	85,0000 %
33	80,0000 %
34	80,0000 %
35	80,0000 %
36	Non Applicabile

**PerfPaniere<sub>2</sub> (t)** = PerfPaniere<sub>1</sub> (t), per tutte le Date di Valutazione.

**Cedola<sub>3</sub> (t)** indica, per ciascuna Data di Valutazione con indice "t", con "t" che va da 1 a 36:

<b>t</b>	<b>Cedola<sub>3</sub> (t)</b>
1	Non Applicabile
2	Non Applicabile
3	Non Applicabile
4	Non Applicabile
5	Non Applicabile
6	Non Applicabile
7	Non Applicabile
8	Non Applicabile
9	0,00000 %
10	0,00000 %
11	0,00000 %
12	0,00000 %
13	0,00000 %
14	0,00000 %
15	0,00000 %
16	0,00000 %
17	0,00000 %
18	0,00000 %
19	0,00000 %
20	0,00000 %
21	0,00000 %
22	0,00000 %
23	0,00000 %
24	0,00000 %

25	0,00000 %
26	0,00000 %
27	0,00000 %
28	0,00000 %
29	0,00000 %
30	0,00000 %
31	0,00000 %
32	0,00000 %
33	0,00000 %
34	0,00000 %
35	0,00000 %
36	Non Applicabile

**H<sub>2</sub> (t)** è Non Applicabile per tutte le Date di Valutazione

**PerfPaniere<sub>3</sub> (t)** = PerfPaniere<sub>1</sub> (t), per tutte le Date di Valutazione.

**Elementi per il calcolo dell'Importo di Rimborso Finale:**

**Cedola<sub>4</sub>** = 0,0000%

**Cedola<sub>5</sub>** = 0,0000%

**H<sub>3</sub>** = 0,0000%

**G** = 100,0000 %

**G<sub>5</sub>** = 0,0000%

**Cap** = Non Applicabile

**Cap<sub>5</sub>** = Non Applicabile

**Floor** = 0,0000%

**Floor<sub>5</sub>** = 0,0000%

**K** = 100,0000%

**K<sub>5</sub>** = 100,0000%

**B** = 60,0000%

**PerfPaniere<sub>4</sub> (T)** = PerfPaniere<sub>1</sub> (t = 36)

**PerfPaniere<sub>5</sub> (T)** = PerfPaniere<sub>1</sub> (t = 36)

**PerfPaniere<sub>6</sub> (T)** = PerfPaniere<sub>1</sub> (t = 36)

**PerfPaniere<sub>7</sub> (T)** = PerfPaniere<sub>1</sub> (t = 36)