**ALLEGATO 17**

**TITOLI CHE DANNO LUOGO A OBBLIGAZIONI DI PAGAMENTO O DI CONSEGNA LEGATE AD UN SOTTOSTANTE**

|  |  |
| --- | --- |
| *Nome Emittente* |  |
| *Tipologia di operazione (se applicabile)* |  |
| *Data di presentazione* |  |

| **TITOLI CHE DANNO LUOGO A OBBLIGAZIONI DI PAGAMENTO O DI CONSEGNA LEGATE AD UN SOTTOSTANTE** | | **CATEGORIA** | **Tabella di corrispondenza con il prospetto** *(se applicabile)* **(1)** | | **Commenti (2)** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Pag.** | **Par.** |  |
| **SEZIONE 1** | FATTORI DI RISCHIO |  |  |  |  |
| **Punto 1.1** | Chiara indicazione dei fattori di rischio significativi per i titoli offerti al pubblico e/o ammessi alla negoziazione, al fine di valutare il rischio di mercato connesso a tali titoli, in una sezione intitolata «Fattori di rischio». Se del caso, questa parte deve includere un avviso agli investitori sul possibile rischio di perdita, totale o parziale, a seconda dei casi, del valore del loro investimento e, nel caso in cui i rischi per gli investitori non si limitino unicamente al loro investimento, una dichiarazione in merito a tale fatto, e la descrizione delle circostanze che determinano il rischio aggiuntivo e i suoi probabili effetti finanziari. | **A** |  |  |  |
| **SEZIONE 2** | INFORMAZIONI RIGUARDANTI I TITOLI DA OFFRIRE/DA AMMETTERE ALLA NEGOZIAZIONE |  |  |  |  |
| **Punto 2.1** | Informazioni relative ai titoli | |  |  |  |
| **Punto 2.1.1** | Fornire una spiegazione chiara e dettagliata che consenta agli investitori di comprendere in che modo il valore del loro investimento sia influenzato dal valore degli strumenti sottostanti, specialmente nei casi in cui i rischi siano più evidenti, a meno che i titoli abbiano un valore nominale unitario pari ad almeno 100 000 EUR, o possano essere acquisiti soltanto ad un prezzo di almeno 100 000 EUR per ogni titolo, o debbano essere negoziati in un mercato regolamentato o un suo specifico segmento a cui solo gli investitori qualificati possano avere accesso. | **B** |  |  |  |
| **Punto 2.1.2** | La data di scadenza degli strumenti derivati e la loro data di esercizio o di riferimento finale. | **C** |  |  |  |
| **Punto 2.1.3** | Descrizione delle modalità di regolamento degli strumenti derivati. | **B** |  |  |  |
| **Punto 2.1.4** | Descrizione dei seguenti elementi:  a) modalità secondo le quali si generano i proventi degli strumenti derivati; | **B** |  |  |  |
| b) la data di pagamento o di consegna; | **C** |  |  |  |
| c) il metodo di calcolo. | **B** |  |  |  |
| **Punto 2.2** | Informazioni relative al sottostante | |  |  |  |
| **Punto 2.2.1** | Il prezzo di esercizio o il prezzo di riferimento definitivo del sottostante. | **C** |  |  |  |
| **Punto 2.2.2** | Dichiarazione indicante il tipo di sottostante. | **A** |  |  |  |
| Indicazione della fonte da cui poter ottenere informazioni sul sottostante, precisando se è possibile ottenere con mezzi elettronici informazioni sul rendimento passato e futuro del sottostante e sulla sua volatilità e se tali informazioni possono essere ottenute gratuitamente. | **C** |  |  |  |
| Nel caso in cui il sottostante sia un titolo, fornire:  a) la denominazione dell’emittente del titolo; | **C** |  |  |  |
| b) il codice internazionale di identificazione dei titoli (ISIN). | **C** |  |  |  |
| Nel caso in cui il sottostante sia un soggetto di riferimento o un’obbligazione di riferimento (per i titoli di tipo credit- linked):  a) se il soggetto di riferimento o l’obbligazione di riferimento consta di un unico soggetto o di un’unica obbligazione oppure, nel caso di un pool di sottostanti, se il soggetto di riferimento o l’obbligazione di riferimento rappresenta il 20 % o più del pool sottostante: |  |  |  |  |
| i) se il soggetto di riferimento (o l’emittente dell’obbligazione di riferimento) non ha titoli ammessi alla negoziazione in un mercato regolamentato, in un mercato equivalente di un paese terzo o in un mercato di crescita per le PMI, per quanto l’emittente ne sappia e/o sia in grado di accertare sulla base di informazioni pubblicate dal soggetto di riferimento (o dall’emittente dell’obbligazione di riferimento), fornire le stesse informazioni sul soggetto di riferimento (o sull’emittente dell’obbligazione di riferimento) che è tenuto a fornire l’emittente (in conformità del documento di registrazione per i titoli diversi dai titoli di capitale destinati agli investitori all’ingrosso); | **A** |  |  |  |
| ii) se il soggetto di riferimento (o l’emittente dell’obbligazione di riferimento) ha titoli già ammessi alla negoziazione in un mercato regolamentato, in un mercato equivalente di un paese terzo o in un mercato di crescita per le PMI, per quanto l’emittente ne sappia e/o sia in grado di accertare sulla base di informazioni pubblicate dal soggetto di riferimento (o dall’emittente dell’obbligazione di riferimento), indicare il nome, il codice ISIN, l’indirizzo, il paese di registrazione, il settore o i settori in cui il soggetto di riferimento (o l’emittente dell’obbligazione di riferimento) opera e il nome del mercato in cui i titoli sono ammessi; | **C** |  |  |  |
| b) nel caso di un pool di sottostanti, se il soggetto unico di riferimento o l’obbligazione unica di riferimento rappresenta meno del 20 % del pool: |  |  |  |  |
| i) i nomi dei soggetti di riferimento o degli emittenti delle obbligazioni di riferimento; | **C** |  |  |  |
| ii) il codice ISIN. | **C** |  |  |  |
| Nel caso in cui il sottostante sia un indice, indicare:  a) il nome dell’indice; | **C** |  |  |  |
| b) la descrizione dell’indice, nel caso sia composto dall’emittente o da soggetti giuridici appartenenti allo stesso gruppo; | **A** |  |  |  |
| c) la descrizione dell’indice fornito dal soggetto giuridico o dalla persona fisica che agisce in associazione con l’emittente o per suo conto, a meno che il prospetto contenga le seguenti dichiarazioni:  i) che la serie completa delle regole dell’indice e le informazioni sull’andamento dell’indice sono liberamente accessibili sul sito web dell’emittente o del fornitore dell’indice;  ii) che le regole applicabili (incluse la metodologia di selezione e ribilanciamento delle componenti dell’indice, la descrizione degli eventi di turbativa del mercato e delle regole di adeguamento) sono basate su criteri prestabiliti e oggettivi. | **B** |  |  |  |
| Le lettere b) e c) non si applicano se l’amministratore dell’indice figura nel registro pubblico tenuto dall’ESMA a norma dell’articolo 36 del regolamento (UE) 2016/ 1011 ( 1 ); |  |  |  |  |
| d) qualora non sia composto dall’emittente, indicare la fonte dalla quale è possibile ottenere informazioni sull’indice. | **C** |  |  |  |
| Qualora il sottostante sia un tasso di interesse, una descrizione del tasso di interesse. | **C** |  |  |  |
| Qualora il sottostante non rientri nelle summenzionate categorie, la nota informativa sui titoli deve contenere informazioni equivalenti. | **C** |  |  |  |
| Qualora il sottostante sia un paniere di sottostanti, indicazione di ciascun sottostante come sopra descritto e del peso percentuale attribuito a ciascun elemento del paniere. | **C** |  |  |  |
| **Punto 2.2.3** | Descrizione di eventuali eventi di credito o fatti perturbativi del mercato o del regolamento aventi un’incidenza sul sottostante. | **B** |  |  |  |
| **Punto 2.2.4** | Regole di adeguamento applicabili in caso di fatti aventi un’incidenza sul sottostante. | **B** |  |  |  |
| **SEZIONE 3** | INFORMAZIONI SUPPLEMENTARI |  |  |  |  |
| **Punto 3.1** | Indicare nel prospetto se l’emittente intende o no fornire informazioni successive all’emissione. In caso affermativo, l’emittente deve specificare nel prospetto quali informazioni saranno comunicate e dove possono essere ottenute. | **C** |  |  |  |

1. Se l’ordine delle informazioni incluse nella bozza di prospetto è diverso dall’ordine in cui dette informazioni sono presentate nello schema di prospetto di cui al Regolamento Delegato (UE) 2019/980, precisare la pagina ed il paragrafo del prospetto in cui le informazioni dello schema sono riportate.
2. Indicare “NON APPLICABILE” ovvero precisare gli “ELEMENTI INFORMATIVI MANCANTI” ossia gli elementi non ancora inseriti nella bozza di documento trasmesso alla Consob. In tal caso precisare la data prevedibile di inclusione tenendo conto che gli stessi devono essere trasmessi alla Consob in tempo utile per la conclusione dell’istruttoria.