

Terme Asymétrique à barrière

Acheteur de la stratégie : EMERAUDE INTERNATIONAL
No de compte 25622A

Date de négociation : 25.02.2022

Nombre de constatations : 52

Fréquence des constatations hebdomadaire
(cf. annexe)

Première date de constatation 02.03.2022

Dernière date de constatation 22.02.2023

1- PREMIERE PERIODE : 4 CONSTATATIONS DU 02/03/2022 au 23/03/2022

Nominal par constatation : 1,000,000 contre 2,000,000 USD

Cours de Conversion 1,0935

Date de règlement : 2 jours ouvrés après la date d'échéance de chaque période

Cours de change de référence : EUR /USD

2- SECONDE PERIODE : 48 CONSTATATIONS DU 30/03/2022 au 22/02/2023

Nominal par constatation : 1,000,000 contre 2,000,000 USD

Cours de Conversion 1,0935

Date de règlement : 2 jours ouvrés après la date d'échéance de chaque période

Cours de change de référence : EUR /USD

Barrière désactivante à l'américaine : 1,1480

Barrière applicable à partir du : 25.02.2022

Taux de participation : 200,00%

Devise de vente : USD contre : EUR

Nominal minimum total de la devise de vente sur la durée de la stratégie: 4 000 000 USD

Nominal maximum total de la devise de vente sur la durée de la stratégie : 104 000 000 USD

Cette pré-confirmation est uniquement destinée à vérifier les termes de l'opération décrite ci-dessus. Une confirmation (au sens de la convention régissant ce type d'opération entre les contreparties) sera émise sur la base de ces éléments et vaudra accord des parties sur les termes de cette transaction. Chacune des parties déclare être autorisée à conclure cette transaction et l'avoir fait de manière indépendante et sur le fondement de son propre jugement compte tenu de ses besoins, aussi, rien dans ce document ne peut être considéré comme un conseil ou un avis financier, fiscal ou juridique de la part de la Banque Neuflize OBC.



ANNEXE

CONSTATATIONS

1	02.03.2022	
2	09.03.2022	
3	16.03.2022	
4	23.03.2022	
5	30.03.2022	
6	06.04.2022	
7	13.04.2022	
8	20.04.2022	
9	27.04.2022	
10	04.05.2022	
11	11.05.2022	
12	18.05.2022	
13	25.05.2022	
14	01.06.2022	
15	08.06.2022	
16	15.06.2022	
17	22.06.2022	
18	29.06.2022	
19	06.07.2022	
20	13.07.2022	
21	20.07.2022	
22	27.07.2022	
23	03.08.2022	
24	10.08.2022	
25	17.08.2022	
26	24.08.2022	
27	31.08.2022	
28	07.09.2022	
29	14.09.2022	
30	21.09.2022	
31	28.09.2022	
32	05.10.2022	
33	12.10.2022	
34	19.10.2022	
35	26.10.2022	
36	02.11.2022	
37	09.11.2022	
38	16.11.2022	
39	23.11.2022	
40	30.11.2022	
41	07.12.2022	
42	14.12.2022	
43	21.12.2022	
44	28.12.2022	
45	04.01.2023	
46	11.01.2023	
47	18.01.2023	
48	25.01.2023	
49	01.02.2023	
50	08.02.2023	
51	15.02.2023	
52	22.02.2023	

BARRIERE
DESACTIVANTE
AMERICAINE 1,1480
OBSERVABLE A
COMPTER DU 25/02/2022
& APPLICABLE SUR LES
ECHEANCES 5 à 52