



**Condizioni Definitive datate 9 novembre 2017**

**Credit Suisse AG, Filiale di Londra**

**Return FX-Linked Securities con scadenza dicembre 2020**

collegate a un paniere di tassi FX (gli "Strumenti Finanziari")

(denominato per scopi commerciali "Credit Suisse Cash Collect su basket di valute Dicembre 2020")

Serie SPLB2017-0SJB

ISIN: XS1009883130

emessi ai sensi del Prospetto di Base relativo ai *Trigger Redeemable e Phoenix Securities*

nell'ambito dello **Structured Products Programme per l'emissione di Notes, Certificates e Warrants**

#### **PARTE A – TERMINI CONTRATTUALI**

I termini usati nel presente documento mantengono la stessa definizione di cui alle Condizioni Generali, le Condizioni di Prodotto e gli *Asset Terms* applicabili (come modificati e/o supplementati fino a, e inclusa, la Data di Emissione) previsti nel Prospetto di Base datato 27 Luglio 2017, come supplementato in data 9 agosto 2017, 31 agosto 2017 e 26 settembre 2017 e da qualsiasi ulteriore supplemento fino a, e inclusa, la Data di Emissione, che congiuntamente costituiscono un prospetto di base ai fini della Direttiva 2003/71/CE, così come di volta in volta modificata, inclusa dalla Direttiva 2010/73/UE (la "**Direttiva Prospetti**"). Il presente documento costituisce le Condizioni Definitive degli Strumenti Finanziari quivi descritti ai fini dell'Articolo 5.4 della Direttiva Prospetti e deve essere letto congiuntamente con il Prospetto di Base così come supplementato. Una nota di sintesi degli Strumenti Finanziari è allegata alle presenti Condizioni Definitive. L'informativa completa sull'Emittente e sull'offerta degli Strumenti Finanziari può essere ottenuta soltanto sulla base della combinazione delle presenti Condizioni Definitive e del Prospetto di Base così come supplementato. Copie del Prospetto di Base e di ciascun supplemento possono essere ottenute presso la sede legale dell'Emittente e presso le sedi degli Agenti quivi indicati.

Le presenti Condizioni Definitive ricomprendono le condizioni definitive per l'emissione e per l'offerta pubblica in Italia e per l'ammissione degli Strumenti Finanziari alle negoziazioni su De@IDone Tradinge Euro TLX. Le Condizioni Definitive saranno disponibili per la consultazione sul(i) sito(i) web dell'Emittente, del Responsabile del Collocamento e del Collocatore(i).

- |    |  |                                       |
|----|--|---------------------------------------|
| 1. | Numero di Serie:                                 | SPLB2017-0SJB                         |
| 2. | Numero di <i>Tranche</i> :                       | Non Applicabile                       |
| 3. | <i>General Terms and Conditions</i> applicabili: | <i>General Certificate Conditions</i> |
| 4. | Tipologia degli Strumenti Finanziari:            | <i>Return Securities</i>              |
| 5. | Valuta di Regolamento:                           | Euro (" <b>EUR</b> ")                 |
| 6. | Istituzionale:                                   | Non Applicabile                       |

**DISPOSIZIONI RELATIVE ALLE NOTES ED AI CERTIFICATES** Applicabile

7.	Numero degli Strumenti Finanziari:	
	(i) Serie:	Fino a 100.000 Strumenti Finanziari
	(ii) <i>Tranche</i> :	Non Applicabile
8.	Prezzo di Emissione:	EUR 100 per Strumento Finanziario
9.	Importo Nominale:	EUR 100
10.	Numero Minimo di Strumenti Finanziari Trasferibili:	Non Applicabile
11.	Numero di Strumenti Finanziari Trasferibili:	Uno Strumento Finanziario
12.	Lotto Minimo di Negoziazione:	Non Applicabile
13.	Data di Emissione:	20 dicembre 2017
14.	Data di Scadenza:	7 Giorni Lavorativi della Valuta successivi alla Data di Fixing Finale o, se tale data cade in date diverse per differenti Attività Sottostanti, l'ultima di tali date (ci si aspetta che sia il 16 dicembre 2020)
15.	Base Cedolare:	Applicabile: <i>Other Coupon Provisions</i>
16.	Base di Rimborso/Pagamento:	FX-linked
17.	Opzioni Put/Call:	Non Applicabile
	<b>DISPOZIONI RELATIVE AI WARRANTS</b>	Non Applicabile

*(I paragrafi da 18 a 28 sono stati cancellati intenzionalmente)*

**DISPOSIZIONI RELATIVE AGLI IMPORTI CEDOLARI**

29.	Disposizioni relative al Tasso Fisso ( <i>General Note Condition 4</i> o <i>General Certificate Condition 4</i> ):	Non Applicabile
30.	Disposizioni del Tasso Variabile ( <i>General Note Condition 4</i> o <i>General Certificate Condition 4</i> ):	Non Applicabile
31.	Disposizioni Premium (General Note Condition 4 o General Certificate Condition 4)	Non Applicabile
32.	Altre Disposizioni della Cedola ( <i>Product Condition 2</i> ):	Applicabile
	(i) Evento di Pagamento Cedolare:	Applicabile
	(a) Importo Cedolare:	Se si è verificato un Evento di Pagamento Cedolare:  Fisso – un importo pari al 2,00 per cento dell'Importo Nominale  Se non si è verificato un Evento di Pagamento

		Cedolare: zero
(b) Evento di Pagamento Cedolare:		Alla Data di Osservazione Cedolare rilevante, la Performance del Paniere è uguale o inferiore alla Soglia Cedolare corrispondente a tale Data di Osservazione Cedolare
(c) Call Cedolare/Put Cedolare:		Non Applicabile
(d) <i>Memory Coupon</i> :		Non Applicabile
(ii) <i>Double No-Touch</i> :		Non Applicabile
(iii) <i>Double No-Touch Accrual</i> :		Non Applicabile
(iv) <i>Double No-Touch Memory</i> :		Non Applicabile
(v) <i>Range Accrual</i> :		Non Applicabile
(vi) <i>Step-Up</i> :		Non Applicabile
(vii) <i>Snowball</i> :		Non Applicabile
(viii) <i>Aggregate Coupon</i> :		Non Applicabile
(ix) <i>Aggregate Memory Coupon</i> :		Non Applicabile
(x) Cap Cedolare:		Non Applicabile
(xi) Floor Cedolare:		Non Applicabile
(xii) <i>FX Adjusted</i> :		Non Applicabile
(xiii) Data(e) di Pagamento Cedolare:		Rispetto a ciascuna Data di Osservazione Cedolare, come specificato nella tabella di seguito riportata relativamente a tale Data di Osservazione Cedolare
(xiv) Soglia Cedolare:		Rispetto a una Data di Osservazione Cedolare, un importo pari al 155 per cento
(xv) Data(e) di Osservazione Cedolare:		Rispetto a un'Attività Sottostante, come specificato nella tabella di seguito riportata con riferimento alla Data di Pagamento Cedolare rilevante
(xvi) Data di Osservazione Cedolare soggetta ad aggiustamento della Data di Valutazione:		Aggiustamento della Data di Valutazione applicabile rispetto a tutte le Date di Osservazione Cedolare
(xvii) Periodo(i) di Osservazione Cedolare:		Non Applicabile
<b>Data<sub>n</sub> di Osservazione Cedolare</b>		<b>Data<sub>n</sub> di Pagamento Cedolare</b>
1. 6 giugno 2018		10 Giorni Lavorativi della Valuta successivi alla Data di Osservazione Cedolare (o, se tale data cade in date diverse per differenti Attività Sottostanti, l'ultima di tali date (ci si aspetta che sia il 20 giugno 2018))
2. 6 dicembre 2018		10 Giorni Lavorativi della Valuta successivi alla Data di Osservazione Cedolare (o, se tale data cade in

		date diverse per differenti Attività Sottostanti, l'ultima di tali date (ci si aspetta che sia il 20 dicembre 2018))
3.	6 giugno 2019	10 Giorni Lavorativi della Valuta successivi alla Data di Osservazione Cedolare (o, se tale data cade in date diverse per differenti Attività Sottostanti, l'ultima di tali date (ci si aspetta che sia il 20 giugno 2019))
4.	6 dicembre 2019	10 Giorni Lavorativi della Valuta successivi alla Data di Osservazione Cedolare (o, se tale data cade in date diverse per differenti Attività Sottostanti, l'ultima di tali date (ci si aspetta che sia il 20 dicembre 2019))
5.	6 giugno 2020	10 Giorni Lavorativi della Valuta successivi alla Data di Osservazione Cedolare (o, se tale data cade in date diverse per differenti Attività Sottostanti, l'ultima di tali date (ci si aspetta che sia il 22 giugno 2020))
6.	6 dicembre 2020	7 Giorni Lavorativi della Valuta successivi alla Data di Osservazione Cedolare (o, se tale data cade in date diverse per differenti Attività Sottostanti, l'ultima di tali date (ci si aspetta che sia il 16 dicembre 2020))
(xviii)	Prezzo di Fixing Cedolare:	Rispetto a un'Attività Sottostante, il Livello di tale Attività Sottostante alla Data di Osservazione Cedolare rilevante
(xix)	Cap del Prezzo di Fixing Cedolare:	Non Applicabile
(xx)	Floor del Prezzo di Fixing Cedolare:	Non Applicabile
(xxi)	Date di Averaging di Osservazione Cedolare:	Non Applicabile
(xxii)	Cut-Off della Cedola Knock-in:	Non Applicabile
(xxiii)	Cedola Lock-in:	Non Applicabile

#### DISPOSIZIONI RELATIVE AL RIMBORSO/PAGAMENTO

33.	Importo di Rimborso o (in caso di <i>Warrants</i> ) Importo del Pagamento ( <i>Product Condition 3</i> ):	Redemption Call
(i)	Percentuale dell'Opzione di Rimborso:	Non Applicabile
(ii)	Performance di Rimborso:	Non Applicabile
(iii)	Cap/Floor dell'Importo di Rimborso:	Non Applicabile
(iv)	Prezzo Strike di Rimborso:	Non Applicabile
(v)	FX Adjustment di Rimborso:	Non Applicabile
34.	Data di Setting Iniziale:	20 dicembre 2017

35.	Date di Averaging Iniziali:	Non Applicabile
36.	Data di Fixing Finale:	6 dicembre 2020
37.	Date di Averaging:	Non Applicabile
38.	Prezzo Finale:	Rispetto a un'Attività Sottostante, il Livello di tale Attività Sottostante alla Data di Fixing Finale
	(i) Cap del Prezzo Finale:	Non Applicabile
	(ii) Floor del Prezzo Finale:	Non Applicabile
39.	Prezzo Strike:	Rispetto a un'Attività Sottostante, il Livello di tale Attività Sottostante alla Data di Setting Iniziale
	(i) Strike Cap:	Non Applicabile
	(ii) Strike Floor:	Non Applicabile
40.	Previsioni Knock-in:	Applicabile
	(i) Evento Knock-in:	Alla Data di Osservazione Knock-in, la Performance del Paniere è pari o inferiore alla Barriera Knock-in
	(ii) Barriera Knock-in:	Rispetto alla Data di Osservazione Knock-in, un importo pari al 155 per cento
	(iii) Dat(a)(e) di Osservazione Knock-in:	Rispetto a un'Attività Sottostante, 6 dicembre 2020
	(iv) Data di Osservazione Knock-in soggetta ad aggiustamento della Data di Valutazione:	Aggiustamento della Data di Valutazione applicabile rispetto alla Data di Osservazione Knock-in
	(v) Periodo di Osservazione Knock-in:	Non Applicabile
	(vi) Prezzo di Fixing Knock-in:	Rispetto a un'Attività Sottostante, il Livello di tale Attività Sottostante alla Data di Osservazione Knock-in
	(vii) Partecipazione Rimborso:	di Applicabile Se si è verificato un Evento Knock-in: zero per cento Se non si è verificato un Evento Knock-in: -64,5161 per cento (pari a un importo uguale a meno 1 <i>diviso</i> per la Barriera Knock-in)
	(viii) Floor:	-100 per cento
	(ix) <i>Knock-out Event Condition:</i>	Non Applicabile
41.	Previsioni Knock-out	Non Applicabile
42.	Rimborso Trigger ( <i>Product Condition 3(c)</i> ):	Non Applicabile
43.	Rimborso Lock-in:	Non Applicabile

44.	Dettagli relativi agli <i>Instalment Securities</i> :	Non Applicabile	
45.	Disposizioni di Regolamento Fisico ( <i>Product Condition 4</i> ):	Non Applicabile	
46.	Opzione Put:	Non Applicabile	
47.	Opzione Call:	Non Applicabile	
48.	Importo di Risoluzione non Programmata:		
	(i) Risoluzione non Programmata alla Pari:	Applicabile	
	(ii) Importo di Pagamento Minimo:	Non Applicabile	
	(iii) Deduzione dei Costi di Copertura:	Non Applicabile	
49.	Turbativa del Pagamento:	Non Applicabile	
50.	Evento addizionale di Turbativa del Tasso di Interesse e di Valuta:	Non Applicabile	
<b>ATTIVITA' SOTTOSTANTE(I)</b>			
51.	Elenco delle Attività Sottostanti:	Applicabile	
	<b>i. Attività Sottostanti<sub>j</sub></b>	<b>Peso<sub>j</sub></b>	<b>Composizione<sub>j</sub></b>
	1. Il Tasso FX EUR/ZAR	0,25	Non Applicabile
	2. Il Tasso FX EUR/TRY	0,25	Non Applicabile
	3. Il Tasso FX EUR/RUB	0,25	Non Applicabile
	4. Il Tasso FX EUR/BRL	0,25	Non Applicabile
52.	Strumenti Finanziari Equity-linked:	Non Applicabile	
53.	Strumenti Finanziari Equity Index-linked:	Non Applicabile	
54.	Strumenti Finanziari Commodity-linked:	Non Applicabile	
55.	Strumenti Finanziari Commodity Index-linked:	Non Applicabile	
56.	Strumenti Finanziari ETF-linked:	Non Applicabile	
57.	Strumenti Finanziari FX-linked:	Applicabile	
	Tasso Singolo FX o Paniere di Tassi FX:	Paniere di Tassi FX	

**Rispetto al Tasso FX EUR/ZAR**

(i)	Tasso FX:	Tasso spot di cambio del rand sudafricano (“ZAR”) per EUR
(ii)	Pagina FX:	Pagina Bloomberg: BFIX
(iii)	Tempo Specificato:	15:00 ora di Londra
(iv)	Sponsor del Tasso FX:	Bloomberg
(v)	Fonte dell’Informazione:	www.bloomberg.com
(vi)	Data di Negoziazione:	15 dicembre 2017
(vii)	<i>Jurisdictional Event</i> :	Non Applicabile
(viii)	<i>Jurisdictional Event Jurisdiction(s)</i> :	Non Applicabile
(ix)	Valuta di Base:	EUR
(x)	Valuta di Riferimento:	ZAR
(xi)	Valuta Specificata:	Non Applicabile
(xii)	<i>Event Currency</i> :	EUR
(xiii)	<i>Non-Event Currency</i> :	ZAR
(xiv)	Convenzione del Giorno Lavorativo FX:	Convenzione del Giorno Lavorativo FX seguente
(xv)	Numero dei Giorni di Regolamento FX:	Non Applicabile
(xvi)	Obbligo di Benchmark:	Non Applicabile
(xvii)	Eventi di Turbativa del Mercato:	
	(a) Default dell’Obbligo di Benchmark:	Non Applicabile
	(b) <i>Dual Exchange Rate</i> :	Applicabile
	(c) Inconvertibilità Generale:	Applicabile
	(d) Non-trasferibilità Generale:	Applicabile
	(e) Default dell’Autorità Governativa:	Non Applicabile
	(f) Illiquidità:	Applicabile
	- Importo Minimo:	Come previsto negli <i>Asset Terms</i>
	- Data di Valutazione:	Non Applicabile

dell'Illiquidità:

- |                                      |  |           |   |
|--------------------------------------|--|-----------|---|
| (g)                                  | Cambiamenti<br>Materiali<br>Circostanze: | nelle     | Applicabile   |
| (h)                                  | Nazionalizzazione:                       |           | Applicabile   |
| (i)                                  | Materialità<br>Prezzo:                   | del       | Non Applicabile   |
| (j)                                  | Turbativa<br>Prezzo:                     | Fonte del | Applicabile   |
| (k)                                  | Inconvertibilità<br>Specifica:           |           | Applicabile   |
|                                      | - Importo<br>Minimo:                     |           | Come previsto negli <i>Asset Terms</i>                            |
| (l)                                  | Non-Trasferibilità<br>Specifica:         |           | Applicabile   |
| (xviii) Fallbacks di Turbativa:      |  |           |   |
| (a)                                  | Determinazione<br>dell'Emittente:        |           | Applicabile – da applicare per secondo                            |
| (b)                                  | Dealers della<br>di Riferimento:         | Valuta    | Non Applicabile   |
| (c)                                  | Prezzo di Riferimento<br>Fallback:       |           | Non Applicabile   |
| (d)                                  | Rinvio:                                  |           | Applicabile – da applicare per primo                              |
|                                      | - Giorni Massimi di<br>Turbativa:        |           | 5 Giorni Lavorativi FX come specificato negli <i>Asset Term 1</i> |
| (xix) Ulteriori Eventi di Turbativa: |  |           |   |
| (a)                                  | Modifiche legislative:                   |           | Applicabile   |
| (b)                                  | Turbativa<br>Copertura:                  | della     | Non Applicabile   |
| (c)                                  | Incremento del Costo<br>della Copertura: |           | Non Applicabile   |

**Rispetto al Tasso FX EUR/TRY**

- |       |                          |   |
|-------|--------------------------|---|
| (i)   | Tasso FX:                | Tasso spot di cambio della lira turca (“TRY”) per EUR |
| (ii)  | Pagina FX:               | Pagina Bloomberg: BFIX                                |
| (iii) | Tempo Specificato:       | 15:00 (ora di Londra)                                 |
| (iv)  | Sponsor del Tasso FX:    | Bloomberg   |
| (v)   | Fonte dell'Informazione: | www.bloomberg.com                                     |

(vi)	Data di Negoziazione:	15 dicembre 2017
(vii)	<i>Jurisdictional Event</i> :	Non Applicabile
(viii)	<i>Jurisdictional Event</i> <i>Jurisdiction(s)</i> :	Non Applicabile
(ix)	Valuta di Base:	EUR
(x)	Valuta di Riferimento:	TRY
(xi)	Valuta Specificata:	Non Applicabile
(xii)	<i>Event Currency</i> :	EUR
(xiii)	<i>Non-Event Currency</i> :	TRY
(xiv)	Convenzione del Giorno Lavorativo FX:	Convenzione del Giorno Lavorativo FX seguente
(xv)	Numero dei Giorni di Regolamento FX:	Non Applicabile
(xvi)	Obbligo di Benchmark:	Non Applicabile
(xvii)	Eventi di Turbativa del Mercato:	
(a)	Default dell'Obbligo di Benchmark:	Non Applicabile
(b)	<i>Dual Exchange Rate</i> :	Applicabile
(c)	Inconvertibilità Generale:	Applicabile
(d)	Non-trasferibilità Generale:	Applicabile
(e)	Default dell'Autorità Governativa:	Non Applicabile
(f)	Illiquidità:	Applicabile
	- Importo Minimo:	Come previsto negli <i>Asset Terms</i>
	- Data di Valutazione dell'Illiquidità:	Non Applicabile
(g)	Cambiamenti Materiali nelle Circostanze:	Applicabile
(h)	Nazionalizzazione:	Applicabile
(i)	Materialità del Prezzo:	Non Applicabile

- |         |                                       |   |
|---------|---------------------------------------|---|
| (j)     | Turbativa Fonte del Prezzo:           | Applicabile   |
| (k)     | Inconvertibilità Specifica:           | Applicabile   |
|         | - Importo Minimo:                     | Come previsto negli <i>Asset Terms</i>                            |
| (l)     | Non-Trasferibilità Specifica:         | Applicabile   |
| (xviii) | Fallbacks di Turbativa:               |   |
| (a)     | Determinazione dell'Emittente:        | Applicabile – da applicare per secondo                            |
| (b)     | Dealers della Valuta di Riferimento:  | Non Applicabile   |
| (c)     | Prezzo di Riferimento Fallback:       | Non Applicabile   |
| (d)     | Rinvio:                               | Non Applicabile – da applicare per primo                          |
|         | - Giorni Massimi di Turbativa:        | 5 Giorni Lavorativi FX come specificato negli <i>Asset Term 1</i> |
| (xix)   | Ulteriori Eventi di Turbativa:        |   |
| (a)     | Modifiche legislative:                | Applicabile   |
| (b)     | Turbativa della Copertura:            | Non Applicabile   |
| (c)     | Incremento del Costo della Copertura: | Non Applicabile   |

**Rispetto al Tasso FX EUR/RUB**

- |        |  |   |
|--------|--|---|
| (i)    | Tasso FX:                                      | Tasso spot di cambio del rublo russo (“ <b>RUB</b> ”) per EUR |
| (ii)   | Pagina FX:                                     | Pagina Bloomberg: BFIX  |
| (iii)  | Tempo Specificato:                             | 15:00 (ora di Londra)   |
| (iv)   | Sponsor del Tasso FX:                          | Bloomberg   |
| (v)    | Fonte dell'Informazione:                       | www.bloomberg.com   |
| (vi)   | Data di Negoziazione:                          | 15 dicembre 2017  |
| (vii)  | <i>Jurisdictional Event</i> :                  | Non Applicabile   |
| (viii) | <i>Jurisdictional Jurisdiction(s): Event</i> : | Non Applicabile   |
| (ix)   | Valuta di Base:                                | EUR   |
| (x)    | Valuta di Riferimento:                         | RUB   |

(xi)	Valuta Specificata:	Non Applicabile
(xii)	<i>Event Currency</i> :	EUR
(xiii)	<i>Non-Event Currency</i> :	RUB
(xiv)	Convenzione del Giorno Lavorativo FX:	Convenzione del Giorno Lavorativo FX seguente
(xv)	Numero dei Giorni di Regolamento FX:	Non Applicabile
(xvi)	Obbligo di Benchmark:	Non Applicabile
(xvii)	Eventi di Turbativa del Mercato:	
	(a) Default dell'Obbligo di Benchmark:	Non Applicabile
	(b) <i>Dual Exchange Rate</i> :	Applicabile
	(c) Inconvertibilità Generale:	Applicabile
	(d) Non-trasferibilità Generale:	Applicabile
	(e) Default dell'Autorità Governativa:	Non Applicabile
	(f) Illiquidità:	Applicabile
	- Importo Minimo:	Come previsto negli <i>Asset Terms</i>
	- Data di Valutazione dell'Illiquidità:	Non Applicabile
	(g) Cambiamenti Materiali nelle Circostanze:	Applicabile
	(h) Nazionalizzazione:	Applicabile
	(i) Materialità del Prezzo:	Non Applicabile
	(j) Turbativa Fonte del Prezzo:	Applicabile
	(k) Inconvertibilità Specifica:	Applicabile
	- Importo Minimo:	Come previsto negli <i>Asset Terms</i>
	(l) Non-Trasferibilità Specifica:	Applicabile
(xviii)	Fallbacks di Turbativa:	
	(a) Determinazione	Applicabile – da applicare per secondo

- dell'Emittente:
- (b) Dealers della Valuta di Riferimento: Non Applicabile
  - (c) Prezzo di Riferimento Fallback: Non Applicabile
  - (d) Rinvio: Non Applicabile – da applicare per primo
    - Giorni Massimi di Turbativa: 5 Giorni Lavorativi FX come specificato negli Asset Term 1
  - (xix) Ulteriori Eventi di Turbativa:
    - (a) Modifiche legislative: Applicabile
    - (b) Turbativa della Copertura: Non Applicabile
    - (c) Incremento del Costo della Copertura: Non Applicabile

**Rispetto al Tasso FX EUR/BRL**

- (i) Tasso FX: Tasso spot di cambio del real brasiliano (“**BRL**”) per EUR
- (ii) Pagina FX: Pagina Bloomberg: BFIX
- (iii) Tempo Specificato: 15:00 ora di Londra
- (iv) Sponsor del Tasso FX: Bloomberg
- (v) Fonte dell'Informazione: [www.bloomberg.com](http://www.bloomberg.com)
- (vi) Data di Negoziazione: 15 dicembre 2017
- (vii) *Jurisdictional Event*: Non Applicabile
- (viii) *Jurisdictional Event Jurisdiction(s)*: Non Applicabile
- (ix) Valuta di Base: EUR
- (x) Valuta di Riferimento: BRL
- (xi) Valuta Specificata: Non Applicabile
- (xii) *Event Currency*: EUR
- (xiii) *Non-Event Currency*: BRL
- (xiv) Convenzione del Giorno Lavorativo FX: Convenzione del Giorno Lavorativo FX seguente
- (xv) Numero dei Giorni di Regolamento FX: Non Applicabile
- (xvi) Obbligo di Benchmark: Non Applicabile

- (xvii) Eventi di Turbativa del Mercato:
- (a) Default dell'Obbligo di Benchmark: Non Applicabile
  - (b) *Dual Exchange Rate*: Applicabile
  - (c) Inconvertibilità Generale: Applicabile
  - (d) Non-trasferibilità Generale: Applicabile
  - (e) Default dell'Autorità Governativa: Non Applicabile
  - (f) Illiquidità: Applicabile
    - Importo Minimo: Come previsto negli *Asset Terms*
    - Data di Valutazione dell'Illiquidità: Non Applicabile
  - (g) Cambiamenti Materiali nelle Circostanze: Applicabile
  - (h) Nazionalizzazione: Applicabile
  - (i) Materialità del Prezzo: Non Applicabile
  - (j) Turbativa Fonte del Prezzo: Applicabile
  - (k) Inconvertibilità Specifica: Applicabile
    - Importo Minimo: Come previsto negli *Asset Terms*
  - (l) Non-Trasferibilità Specifica: Applicabile
- (xviii) Fallbacks di Turbativa:
- (a) Determinazione dell'Emittente: Applicabile – da applicare per secondo
  - (b) Dealers della Valuta di Riferimento: Non Applicabile
  - (c) Prezzo di Riferimento Fallback: Non Applicabile
  - (d) Rinvio: Non Applicabile – da applicare per primo
    - Giorni Massimi di 5 Giorni Lavorativi FX come specificato negli Asset

	Turbativa	Term 1
(xix)	Ulteriori Eventi di Turbativa:	
	(a) Modifiche legislative:	Applicabile
	(b) Turbativa della Copertura:	Non Applicabile
	(c) Incremento del Costo della Copertura:	Non Applicabile
58.	Strumenti Finanziari <i>FX Index-linked</i> :	Non Applicabile
59.	Strumenti Finanziari <i>Inflation Index-linked</i> :	Non Applicabile
60.	Strumenti Finanziari <i>Interest Rate Index-linked</i> :	Non Applicabile
61.	Strumenti Finanziari <i>Cash Index-linked</i> :	Non Applicabile
62.	Strumenti Finanziari <i>Multi-Asset Basket-linked</i> :	Non Applicabile
63.	Tempo della Valutazione:	Non Applicabile

#### DISPOSIZIONI GENERALI

64.	(i) Forma degli Strumenti Finanziari:	Strumenti Finanziari Nominativi
	(ii) Strumento Finanziario Globale:	Applicabile
	(iii) Detenuti ai sensi del NSS:	Non Applicabile
	(iv) Destinati ad essere detenuti in modo da consentire l' idoneità dell'Eurosistema:	No
	(v) L'Emittente intende consentire partecipazioni indirette agli Strumenti Finanziari da detenere mediante Interessi Depositari CREST ( <i>CREST Depository Interests</i> ) da emettere attraverso il Depositario CREST:	Non Applicabile
65.	Centro(i) Finanziario(i):	Non Applicabile
66.	Centro(i) Business:	Non Applicabile
67.	Quotazione e Ammissione alle	Sarà presentata domanda di ammissione degli Strumenti Finanziari alla negoziazione sul sistema

Negoziazioni:

multilaterale di negoziazione EuroTLX<sup>®</sup> (“**EuroTLX**”), organizzato e gestito da EuroTLX SIM S.p.A. con effetto da o intorno alla Data di Emissione fermo restando che, in ogni caso, non esiste alcuna garanzia che tale domanda per la quotazione e l’ammissione alla negoziazione venga concessa (o, se concessa, a partire dalla Data di Emissione o qualunque altra data in avanti).

Sarà presentata domanda di ammissione degli Strumenti Finanziari alla quotazione sul Sistema di Negoziazione (“**De@IDone Trading**” o “**DDT**”) gestito esclusivamente da MPS Capital Services Banca per le Imprese S.p.A. (“**MPSCS**”), che non è un mercato regolamentato ai sensi della Direttiva 2004/39/CE relativa ai Mercati degli Strumenti Finanziari (come modificata, variata e sostituita di volta in volta a seguito dell’implementazione della Direttiva 2014/65/UE).

L’Offerta degli Strumenti Finanziari è subordinata al consenso prestato dal DDT in merito all’ammissione alla negoziazione degli Strumenti Finanziari prima della Data di Emissione.

MPSCS pertanto si impegna a presentare domanda per l’ammissione degli Strumenti Finanziari alle negoziazioni sul DDT, in tempo utile per l’emissione del provvedimento di ammissione entro tale data ed in conformità con il regolamento del DDT.

MPSCS agirà quale negoziatore unico su DDT, come disciplinato dalle norme e dai regolamenti vigenti (*il Regolamento*) pubblicati sul sito web [www.mpscapitalservices.it](http://www.mpscapitalservices.it). MPSCS dovrà fornire delle quotazioni bid-ask per un importo di Strumenti Finanziari pari all’Importo Collocato (come sotto definito) da determinarsi come segue.

MPSCS determinerà il prezzo per tali quotazioni bid/ask che rifletterà le condizioni di mercato prevalenti al tempo delle quotazioni. Il prezzo così determinato, in caso di “quotazioni ask” (acquisto dell’investitore) sarà incrementato di un margine fino a un massimo dello 0,35 per cento; nel caso di “quotazioni bid” (vendita dell’investitore) sarà diminuito di un margine fino a un massimo del 1,00 per cento.

MPSCS è responsabile delle informazioni contenute in questo paragrafo 67.

Per quanto sopra: “**Importo Collocato**” indica il *prodotto* di (a) l’Importo Nominale e (b) il numero degli Strumenti Finanziari effettivamente collocati dal Collocatore alla fine del Periodo di Offerta come notificato da MPSCS all’Emittente.

MPSCS inizierà la negoziazione su tale internalizzatore sistematico (DDT) al più tardi entro 5 giorni lavorativi successivi alla Data di Emissione.

Inoltre, MPSCS richiederà l'ammissione alla quotazione e alla negoziazione degli Strumenti Finanziari sul sistema multilaterale di negoziazione EuroTLX<sup>®</sup>, organizzato e gestito da EuroTLX SIM S.p.A.. MPSCS agirà in qualità di "liquidity provider" (specialista) ai sensi del Regolamento di Euro TLX.

L'esecuzione degli ordini su EuroTLX verrà effettuata sulla base del Regolamento di EuroTLX pubblicato su [www.eurotlx.com](http://www.eurotlx.com). MPSCS anticipa che la negoziazione su EuroTLX avrà inizio al più tardi entro 5 giorni lavorativi successivi alla Data di Emissione.

Il Regolamento di EuroTLX può essere scaricato dal sito [www.eurotlx.com](http://www.eurotlx.com)

68. Codici e Simboli *Ticker* degli Strumenti Finanziari:
- ISIN: XS1009883130
- Common Code*: 100988313
- Swiss Security Number*: 36486470
- Telekurs Ticker*: Non Applicabile
- WKN Number: Non Applicabile
69. Gestione Accentrata e Negoziazione:
- Sistema(i) di Gestione Accentrata e relativo(i) numero(i) identificativo(i): Euroclear Bank S.A./N.V., Clearstream Banking, *société anonyme*
70. Consegna: Consegna a fronte di pagamento
71. Agenti:
- Agente di Calcolo: Credit Suisse International  
One Cabot Square  
Londra E14 4QJ
- Principal Certificate Agent*: The Bank of New York Mellon, che opera tramite la propria Filiale di Londra  
One Canada Square  
Londra E14 5AL
- Agente(i) per il Pagamento: The Bank of New York Mellon, che opera tramite la propria Filiale di Londra  
One Canada Square  
Londra E14 5AL
- Agenti Aggiuntivi: Applicabile
- Registrar*: The Bank of New York Mellon S.A./N.V., Filiale del Lussemburgo  
Vertigo Building - Polaris  
2-4 rue Eugene Ruppert

- L-2453 Lussemburgo
72. *Dealer(s)*: Credit Suisse International.
73. Quotidiani previsti per la comunicazione di avvisi ai Portatori degli Strumenti Finanziari: Non Applicabile
74. Strumenti Finanziari 871(m): L'Emittente ha stabilito che gli Strumenti Finanziari (senza considerare altre operazioni) non dovrebbero essere considerati come operazioni soggette alla *U.S. withholding tax* ai sensi della sezione 871(m)
75. Disposizioni Aggiuntive: Non Applicabile

## PARTE B – ALTRE INFORMAZIONI

### Termini e Condizioni dell'Offerta

1. Prezzo dell'Offerta: Il Prezzo di Offerta sarà uguale al Prezzo di Emissione.  
  
Per quanto riguarda le commissioni applicabili si veda di seguito il punto 11.
2. Ammontare totale dell'offerta. Se l'ammontare non è stato fissato, descrizione degli accordi e del momento in cui l'ammontare definitivo dell'offerta sarà annunciato al pubblico: Fino a 100.000 Strumenti Finanziari.  
  
Da determinare sulla base della domanda di Strumenti Finanziari e delle condizioni prevalenti di mercato e pubblicato in conformità all'articolo 8 della Direttiva Prospetti.
3. Condizioni (aggiuntive rispetto a quelle descritte nel Prospetto di Base) alle quali l'offerta è assoggettata: L'offerta degli Strumenti Finanziari è subordinata alla loro emissione e al consenso prestato dal DDT in merito all'ammissione alla negoziazione degli Strumenti Finanziari prima della Data di Emissione.  
  
Diritto di revoca o di recesso: L'offerta può essere revocata nel caso in cui l'Emittente e il Responsabile del Collocamento valutino che, per qualunque ragione incluse, tra le altre, una qualsiasi legge vigente, sentenza, decisione di un organo governativo o di un'altra autorità o altri simili fattori rendano illegale, impossibile o non pratico, in tutto o in parte, completare l'offerta ovvero che si sono verificati cambiamenti negativi sostanziali nelle condizioni di mercato. In caso di revoca, il Collocatore rimborserà il prezzo di acquisto e qualsiasi commissione pagata a ciascun compratore senza interessi.  
  
La comunicazione di revoca dell'offerta sarà pubblicata sul sito web dell'Emittente, del Responsabile del Collocamento e del Collocatore, rispettivamente su <https://derivative.credit-suisse.com/it/>, [www.mpscapitalservices.it](http://www.mpscapitalservices.it) e [www.mps.it](http://www.mps.it)
4. Periodo in cui l'offerta resterà aperta ("**Periodo di Offerta**"): Un'offerta di Strumenti Finanziari verrà fatta in Italia durante il periodo che va dal, e incluso, 10 novembre 2017 al, e incluso, 15 dicembre 2017.  
  
Il Periodo di Offerta può essere sospeso in qualunque momento dall'Emittente e dal Responsabile del Collocamento. La comunicazione della chiusura anticipata del Periodo di Offerta sarà data agli investitori con mezzi adeguati (anche mediante avviso pubblicato sul sito web dell'Emittente, del Responsabile del Collocamento e del Collocatore su, rispettivamente, <https://derivative.credit-suisse.com/it/>, [www.mpscapitalservices.it](http://www.mpscapitalservices.it) e [www.mps.it](http://www.mps.it)). Si veda oltre la sezione intitolata "Informazioni sull'ammontare minimo e/o massimo della richiesta" descritto al seguente punto 7.
5. Descrizione della procedura di adesione: Un'offerta di Strumenti Finanziari diversa da quanto previsto dall'articolo 3(2) della Direttiva Prospetto può essere effettuata in Italia dal Responsabile del

Collocamento attraverso il Collocatore durante il Periodo di Offerta.

Possono essere fatte richieste di Strumenti Finanziari in Italia attraverso il Collocatore durante il Periodo di Offerta. Gli Strumenti Finanziari saranno collocati in Italia attraverso il Collocatore. La distribuzione sarà effettuata secondo le consuete procedure del Collocatore.

Gli investitori interessati a sottoscrivere gli Strumenti Finanziari durante il Periodo di Offerta e durante le ore di ufficio del Collocatore, potranno inoltrare richiesta presso le filiali del Collocatore consegnando una specifica scheda di adesione debitamente compilata e firmata (anche tramite rappresentanti).

La scheda di adesione è disponibile presso le filiali del Collocatore. Non ci sono limiti al numero di richieste di sottoscrizione che possono essere compilate e consegnate da parte dello stesso potenziale investitore attraverso il Collocatore. La partecipazione degli investitori all'offerta non può essere soggetta a condizioni e, una volta che la richiesta di sottoscrizione è stata firmata dal potenziale investitore e trasmessa al Collocatore (o ad uno dei suoi rappresentanti), la richiesta stessa non può più essere revocata dal relativo investitore salvo i casi in cui ciò sia consentito ai sensi delle leggi e regolamenti vigenti.

6. Descrizione della possibilità di ridurre le sottoscrizioni e modalità di rimborso dell'ammontare in eccedenza versato dai richiedenti: Non Applicabile.
7. Informazioni sull'ammontare minimo e/o massimo della richiesta: Non ci sono criteri di riparto. Tutti gli Strumenti Finanziari richiesti tramite il Collocatore durante il Periodo di Offerta saranno assegnati sino all'importo massimo dell'offerta, e non saranno in seguito accettate ulteriori richieste di sottoscrizione.
- L'ammontare massimo di domanda di Strumenti Finanziari sarà soggetto soltanto alla disponibilità al momento della richiesta.
- Nel caso in cui durante il Periodo di Offerta le richieste dovessero superare l'importo totale dell'offerta, l'Emittente e il Responsabile del Collocamento chiuderanno anticipatamente il Periodo di Offerta ai sensi del punto 4 di cui sopra e sospenderanno immediatamente la ricezione di ulteriori richieste.
8. Informazioni sulla modalità e i termini del pagamento a saldo e della consegna degli Strumenti Finanziari: I pagamenti per gli Strumenti Finanziari saranno effettuati al Collocatore nel rispetto delle procedure in materia di sottoscrizione di strumenti finanziari in generale concordate tra il Collocatore e la sua clientela, secondo le istruzioni del Collocatore.
- Ci si aspetta che gli Strumenti Finanziari siano consegnati sul conto titoli dei rispettivi acquirenti alla

data che sarà notificata dal Collocatore o in prossimità alla stessa.

9. Modo e data in cui saranno pubblicati i risultati dell'Offerta: Una comunicazione relativa ai risultati dell'Offerta sarà pubblicata sul sito web dell'Emittente, del Responsabile del Collocamento e del Collocatore, rispettivamente su <https://derivative.credit-suisse.com/it/>, [www.mpscapitalervices.it](http://www.mpscapitalervices.it) e [www.mps.it](http://www.mps.it) non più tardi di 5 Giorni Lavorativi TARGET dopo la chiusura del Periodo di Offerta.
10. Procedura di notifica ai sottoscrittori dell'ammontare assegnato e indicazione se le contrattazioni possono iniziare prima dell'effettuazione della notifica: I richiedenti saranno avvisati del buon esito della loro richiesta dal Collocatore.
11. Ammontare delle spese e delle imposte addebitate specificatamente al sottoscrittore o all'acquirente: Il Dealer pagherà al Collocatore commissioni di collocamento attraverso il Responsabile del Collocamento e commissioni di direzione al Responsabile del Collocamento in connessione con l'Offerta. Le commissioni di collocamento e le commissioni di direzione potrebbero variare rispettivamente da un minimo del 2,10 per cento a un massimo del 2,60 per cento dell'Importo Nominale per Strumento Finanziario e da un minimo dello 0,525 per cento a un massimo dello 0,65 per cento dell'Importo Nominale per Strumento Finanziario.
- Le commissioni di collocamento e le commissioni di direzione rispettivamente pagabili dal Dealer al Distributore (tramite il Responsabile di Collocamento) ed al Responsabile di Collocamento saranno determinate sulla base delle prevalenti condizioni di mercato durante il Periodo di Offerta e saranno pubblicate mediante avviso non più tardi di 5 Giorni Lavorativi TARGET dopo la Data di Emissione sul sito web dell'Emittente, del Responsabile del Collocamento e del Distributore, rispettivamente <https://derivative.credit-suisse.com/it/>, [www.mpscapitalervices.it](http://www.mpscapitalervices.it) e [www.mps.it](http://www.mps.it).
- Il Prezzo di Offerta e le condizioni degli Strumenti Finanziari tengono in conto tali commissioni e il Prezzo di Emissione potrebbe essere superiore al valore di mercato degli Strumenti Finanziari alla Data di Emissione.
- L'Emittente non è a conoscenza di eventuali spese o tasse specificamente addebitate al sottoscrittore e non comunicate nel presente documento.
- Si veda la sezione intitolata "Interessi delle Persone Fisiche e Giudiriche coinvolte nell'Offerta" sotto per maggiori informazioni.
12. Nome/i e indirizzo/i, per quanto risulta all'Emittente, dei collocatori (i "Collocatori") nei vari paesi in Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.  
Piazza Salimbeni, 3  
Siena

cui ha luogo l'offerta:

Italia (il "Collocatore")

MPS Capital Services Banca per le Imprese S.p.A.  
Via L. Pancaldo, 4  
Firenze

Italia (il "Responsabile del Collocamento")

13. Consenso:

L'Emittente acconsente che il Prospetto di Base sia utilizzato dagli intermediari finanziari ("Offerent(e)(i) Autorizzat(o)(i)") durante il Periodo di Offerta e ai sensi delle seguenti condizioni:

- (a) Nome e indirizzo dell' Offerent(e)(i) Autorizzat(o)(i): Vedere elemento 12 sopra
- (b) Periodo di offerta per il quale l'uso del Prospetto di Base da parte (dell')(degli) Offerent(e)(i) Autorizzat(o)(i) è autorizzato: Periodo di Offerta
- (c) Condizioni per l'utilizzo del Prospetto di Base da parte dell'(degli) Offerente(i) Autorizzato(i): Il Prospetto di Base può essere utilizzato solo dall'(dagli) Offerente(i) Autorizzato(i) per offerte degli Strumenti Finanziari nella(e) giurisdizione(i) nella(e) quale(i) l'Offerta non esente si svolge.

**Qualora intenda acquistare gli Strumenti Finanziari da un Offerente Autorizzato, potrà farlo, e tale offerta e vendita saranno fatte, nel rispetto dei termini e degli accordi in essere fra Lei e l'Offerente Autorizzato, incluso quanto stabilito con riferimento al prezzo e al pagamento. L'Emittente non sarà parte di alcuno di questi accordi e le informazioni relative a tali accordi, di conseguenza, non sono incluse nel Prospetto di Base. I termini e le condizioni di tale offerta dovrebbero essere comunicate dall'Offerente Autorizzato al tempo in cui è fatta l'offerta. Né l'Emittente né alcuno dei *dealer* sono responsabili di o per tali informazioni fornite dall'Offerente Autorizzato.**

#### Interessi delle Persone Fisiche e Giuridiche coinvolte nell'Emissione

Fermo restando quanto indicato di seguito e nella sezione fattori di rischio di cui al Prospetto di Base "Rischi associati ai conflitti di interesse tra il relativo Emittente e i detentori degli Strumenti Finanziari", nessun soggetto coinvolto nell'offerta degli Strumenti Finanziari ha un interesse rilevante nell'offerta.

MPSCS in qualità di Responsabile del Collocamento e Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. in qualità di Collocatore sono, per quanto riguarda l'offerta degli Strumenti Finanziari, in una posizione di conflitto di interessi con gli investitori dal momento che fanno parte dello stesso gruppo bancario

(Gruppo Montepaschi) e hanno un interesse economico in relazione alla distribuzione degli Strumenti Finanziari. MPSCS e il Collocatore riceveranno dall'Emittente, rispettivamente, la commissione di direzione e la commissione di collocamento, come sopra specificato al paragrafo 11 della Parte B.

MPSCS è inoltre in una posizione di conflitto di interesse per le seguenti ragioni: (a) agisce in qualità di controparte di copertura di Credit Suisse International, che è parte dello stesso gruppo dell'Emittente, in relazione all'emissione degli Strumenti Finanziari, (b) sarà effettuata una richiesta in relazione a Strumenti Finanziari da ammettere alla negoziazione su DDT, che è gestito esclusivamente da MPSCS e rispetto al quale MPSCS agisce in qualità di negoziatore unico, (c) MPSCS agirà in qualità di "liquidity provider", offrendo quotazioni bid/ask per gli Strumenti Finanziari a beneficio dei Detentori degli Strumenti Finanziari e (d) sarà effettuata una richiesta in relazione a Strumenti Finanziari da ammettere alla negoziazione su EuroTLX, sul quale MPSCS agisce in qualità di specialista.

**Performance di Azione/Indice/Merce/Indice di Merce/Azione ETF/Tasso FX/Indice FX/Indice di Inflazione/Indice del Tasso di Interesse/Cash Index e altre informazioni riguardanti l(a)(e) Attività Sottostant(e)(i)**

Informazioni concernenti ciascuna delle seguenti Attività Sottostante, incluse le informazioni passate e future relative all'andamento e alla volatilità, possono essere trovate presso [www.bloomberg.com](http://www.bloomberg.com).

Le informazioni che appaiono su tali siti web non sono parte delle presenti Condizioni Definitive.

**INFORMAZIONI POST-EMISSIONE**

L'Emittente non fornirà alcuna informazione post-emissione con riferimento alle Attività Sottostanti, a meno che sia richiesto dalla legge o da regolamenti applicabili.

**RAGIONI PER L'OFFERTA, RICAVI NETTI STIMATI E SPESE TOTALI**

- |       |                        |  |
|-------|------------------------|--|
| (i)   | Ragioni per l'offerta: | Vedere la sezione "Utilizzo dei Ricavi" di cui al Prospetto di Base                  |
| (ii)  | Ricavi netti stimati:  | Non Applicabile.   |
| (iii) | Spese totali stimate:  | Non Applicabile; non ci si aspetta che l'Emittente addebiterà spese all'investitore. |

Sottoscritto per conto dell'Emittente:

Da: \_\_\_\_\_

Debitamente autorizzato

Da: \_\_\_\_\_

Debitamente autorizzato

