Brochure commerciale

MARATEA 21 TRIMESTRIEL AOÛT 22 - 16_

COMMUNICATION À CARACTÈRE PROMOTIONNEL

Titre de créance complexe de droit français présentant un risque de perte en capital partielle ou totale en cours de vie et à l'échéance.

Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 est un titre de créance risqué alternatif à un investissement dynamique de type actions.

Titre de créance émis par Natixis Structured Issuance SA (l'« Émetteur »), véhicule d'émission au Luxembourg offrant une garantie de formule donnée par Natixis (le « Garant » ; Standard & Poor's : A/Moody's : A1/Fitch Ratings : A+[1]). L'investisseur supporte les risques de défaut, d'ouverture d'une procédure de résolution et de faillite de l'Émetteur et du Garant.

Durée d'investissement conseillée_ 10 ans (hors cas de remboursement anticipé). L'investisseur prend un risque de perte en capital non mesurable si le titre de créance est revendu avant la Date d'Échéance.

Période de commercialisation_ du 7 juillet 2022 au 25 août 2022. La période de commercialisation peut être close à tout moment.

Éligibilité_ Compte titres et unité de compte d'un contrat d'assurance vie ou de capitalisation. La présente brochure décrit les caractéristiques de Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 et ne prend pas en compte les spécificités des contrats d'assurance-vie ou de capitalisation dans le cadre desquels ce titre de créance est proposé. **Dans le cadre d'un contrat d'assurance-vie ou de capitalisation, l'assureur s'engage exclusivement sur le nombre d'unités de compte mais non sur leur valeur, qu'il ne garantit pas. Il est précisé que l'entreprise d'assurance d'une part, l'Émetteur d'autre part, sont des entités juridiques indépendantes.**

ISIN_FR001400BEI2

Ce document à caractère promotionnel n'a pas été rédigé par l'assureur.

VOUS ÊTES SUR LE POINT D'ACHETER UN PRODUIT QUI N'EST PAS SIMPLE ET QUI PEUT ÊTRE DIFFICILE À COMPRENDRE.

SILEX

1. Notations en vigueur au moment de la rédaction de la brochure. Ces notations peuvent être révisées à tout moment par les agences de notation.

. Points clés_

Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 est un titre de créance qui présente un risque de perte en capital partielle ou totale en cours de vie et à l'échéance, et dont les caractéristiques sont les suivantes :

- Une exposition à la performance du marché actions, via **l'indice iEdge Europe Climate Equal Weight 40 Decrement 50 Points Gross Total Return®** (« l'Indice »), calculé dividendes bruts réinvestis et diminué d'un montant fixe de 50 points d'indice par an.

- **Un objectif de gain de 4,00 %[1] par trimestre écoulé,** soit 16,00 % par année écoulée, si le niveau de l'Indice est supérieur ou égal à son Niveau Initial à une Date d'Observation Trimestrielle[2] ou à la Date d'Observation Finale[2].

- **Un mécanisme de remboursement automatique anticipé possible dès la fin du 7e trimestre**, si le niveau de l'Indice est supérieur ou égal à son Niveau Initial à une Date d'Observation Trimestrielle[2].

- **Un remboursement du Capital Initial[1] à l'échéance** si le niveau de l'Indice est supérieur ou égal à 60 % de son Niveau Initial à la Date d'Observation Finale[2].

- **Une perte en capital partielle ou totale**, si le niveau de l'Indice est strictement inférieur à 60 % de son Niveau Initial à la Date d'Observation Finale[2].

- **Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16** est un titre de créance dont les fonds levés dans le cadre de l'émission ne seront pas spécifiquement alloués au financement de projets en lien avec la transition énergétique. Il est important de noter que seul l'Indice est construit de façon à sélectionner les actions des entreprises les plus engagées dans leur approche ESG. L'exposition de l'investisseur à la performance d'un indice ne signifie pas qu'il finance les actions le composant. **Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 ne constitue pas un titre de créance vert.**

1. Hors frais, commissions, et hors fiscalité et prélèvements sociaux applicables, sous réserve de l'absence de défaut, d'ouverture d'une procédure de résolution et de faillite de l'Émetteur et du Garant et de la conservation du titre de créance jusqu'à son remboursement final. En cas de sortie en cours de vie alors que les conditions du remboursement automatique ne sont pas réunies, le montant remboursé dépendra des paramètres de marché en vigueur et engendrera un gain ou une perte non mesurable a priori. La perte en capital, notamment, pourra être partielle ou totale.
2. Veuillez vous référer au tableau récapitulant les principales caractéristiques financières en page 10 pour le détail des dates.

Les termes « Capital » ou « Capital Initial » utilisés dans cette brochure désignent la Valeur Nominale du titre de créance Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16, soit 1 000 euros. Les gains ou pertes résultant de l'investissement sur ce titre de créance s'entendent hors frais, commissions, et hors fiscalité et prélèvements sociaux applicables, sous réserve de l'absence de défaut, d'ouverture d'une procédure de résolution et de faillite de l'Émetteur et du Garant et de la conservation du titre de créance jusqu'à son remboursement final. Les Taux de Rendement Annuel nets sont nets de frais de gestion dans le cas d'un contrat d'assurance-vie ou de capitalisation ou nets de droits de garde dans le cas d'un investissement en comptes-titres (en prenant comme hypothèse un taux de frais de gestion ou de droit de garde de 1 % par an) et sont calculés hors prélèvements fiscaux et sociaux. D'autres frais, tels que les frais d'entrée ou d'arbitrage dans le cas d'un contrat d'assurance, pourront être appliqués. Pour en savoir plus, nous vous invitons à vous rapprocher de votre conseiller. L'investisseur supporte les risques de défaut, d'ouverture d'une procédure de résolution et de faillite de l'Émetteur et du Garant. Dans cette brochure, les calculs de TRA sont effectués pour un investissement de 1 000 euros le 25 août 2022 jusqu'à la Date d'Échéance (le 8 septembre 2032) ou, selon le cas, de Remboursement Automatique Anticipé. En cas d'achat après le 25 août 2022 et/ou de vente du titre de créance avant son échéance effective (et/ ou en cas d'arbitrage ou de rachat pour les contrats d'assurance-vie/ capitalisation, ou de dénouement par décès pour les contrats d'assurance-vie), le Taux de Rendement Annuel peut être supérieur ou inférieur au Taux de Rendement Annuel indiqué dans la présente brochure. De plus, l'investisseur peut subir une perte en capital. La présente brochure décrit les caractéristiques du titre de créance Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16, ne prend pas en compte les spécificités des contrats d'assurance-vie ou de capitalisation dans le cadre desquels ce titre de créance est proposé. **L'assureur s'engage exclusivement sur le nombre d'unités de compte mais non sur leur valeur, qu'il ne garantit pas. Il est précisé que l'assureur d'une part, et l'Émetteur et le Garant de la formule d'autre part, sont des entités juridiques distinctes. Ce document n'a pas été rédigé par l'assureur.**

. Avantages/Inconvénients_

Avantages_

- De la fin du 7e trimestre à la fin du 39e trimestre, si à une Date d'Observation Trimestrielle[1], le niveau de l'Indice est supérieur ou égal à son Niveau Initial, l'investisseur bénéficie d'un **mécanisme de remboursement automatique anticipé**, et récupère son Capital Initial majoré d'un **gain de 4,00 %[2] par trimestre écoulé, soit 16,00 % par année écoulée**.
- **À l'échéance des 10 ans**, si Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 n'a pas été rappelé par anticipation, et si le niveau de l'Indice est supérieur ou égal à son Niveau Initial à la Date d'Observation Finale[1], l'investisseur récupère l'**intégralité de son Capital Initial augmenté d'un gain final de 160,00 %[2], soit 16,00 % par année écoulée**.
- **À l'échéance des 10 ans**, si Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 n'a pas été rappelé par anticipation, l'investisseur bénéficie d'un remboursement de **l'intégralité de son Capital Initial[2]**, si le niveau de l'Indice est strictement inférieur à son Niveau Initial mais supérieur ou égal à 60 % de son Niveau Initial à la Date d'Observation Finale[1].

Inconvénients_

- Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 **présente un risque de perte partielle ou totale du capital en cours de vie** (en cas de revente du titre de créance à l'initiative de l'investisseur alors que les conditions de remboursement automatique ne sont pas remplies, le prix dépendant alors des paramètres de marché le jour de la revente) **et à l'échéance** (si, à la Date d'Observation Finale[1], le niveau de l'Indice est strictement inférieur à 60 % de son Niveau Initial). La valorisation de Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 est très sensible, à l'échéance, à une faible variation du niveau de l'Indice autour des seuils de 60 % et de 100 % de son Niveau Initial.
- **L'investisseur ne connaît pas à l'avance la durée exacte de son investissement** qui peut durer de 7 à 40 trimestres, soit de 1 an et 9 mois à 10 ans.
- **Le gain maximum de l'investisseur est limité à 4,00 %[2] par trimestre écoulé, soit 16,00 % par année écoulée**. L'investisseur ne profite pas pleinement de la hausse du niveau de l'Indice (Effet de Plafonnement du Gain).
- **L'investisseur est exposé à un éventuel défaut** (qui induit un risque de non remboursement) ou à **une dégradation de la qualité de crédit** (qui induit un risque sur la valeur de marché du titre de créance) de l'Émetteur et à un risque de défaut, d'ouverture d'une procédure de résolution et de faillite du Garant.
- **L'Indice ne présente pas le rendement total des actifs dans lesquels il est investi**. L'Indice est calculé dividendes bruts réinvestis, diminué d'un montant fixe de 50 points d'indice par an. **Le montant des dividendes réinvestis dans l'Indice peut être inférieur ou supérieur à ce montant forfaitaire.**

. Facteurs de Risques_

Les investisseurs sont invités à lire attentivement la section « Facteurs de Risques » du Prospectus de Base (tel que défini dans la section « Informations Importantes » de la présente brochure). Ces risques sont notamment :

- **Risque de perte en capital :** En cas de cession des titres de créance avant l'échéance, le prix de cession desdits titres pourra être inférieur à son prix de commercialisation. L'investisseur prend donc un risque de perte en capital non mesurable a priori. Dans le pire des scénarios, les investisseurs pourraient perdre tout ou partie de leur investissement.
- **Risque de perte en capital lié au Sous-Jacent :** Le remboursement du capital dépend de la performance du Sous-Jacent. Ces montants seront déterminés par application d'une formule de calcul (voir le mécanisme de remboursement) en relation avec le Sous-Jacent. Dans le cas d'une évolution défavorable de la performance du Sous-Jacent, les investisseurs pourraient subir une baisse substantielle des montants dus lors du remboursement et pourraient perdre tout ou partie de leur investissement.
- **Risques liés à l'éventuelle ouverture d'une procédure de résolution ou de faillite :** En cas d'ouverture d'une procédure de résolution au niveau de l'Emetteur et/ou du Garant et/ou du Groupe BPCE ou en cas de faillite de l'Emetteur et/ou du Garant, les investisseurs pourraient perdre tout ou partie de leur investissement initial et/ou ne pas recevoir la rémunération initialement prévue.
- **Risque de volatilité, risque de liquidité :** Une forte volatilité des cours (amplitude des variations des cours) ou une faible liquidité pourrait avoir un impact négatif sur le prix de cession des titres de créance. En cas de cession des titres de créance avant l'échéance, le prix de cession pourrait être inférieur à ce qu'un investisseur pourrait attendre compte tenu de la valorisation desdits titres de créance. En l'absence de liquidité, les investisseurs pourraient ne pas être en mesure de les céder.
- **Risques liés à la modification, suppression ou perturbation du Sous-Jacent :** SGX, l'administrateur du Sous-Jacent, pourrait modifier de façon significative le Sous-Jacent, l'annuler ou ne pas publier son niveau. Dans ces cas et au choix de l'Agent de Calcul, le niveau du Sous-Jacent pourrait être calculé conformément à la formule et la méthode de calcul en vigueur avant cet évènement, être remplacé par celui d'un autre Sous-Jacent ou les titres de créances pourraient faire l'objet d'un remboursement anticipé à leur juste valeur de marché. Dans ces cas, les montants de remboursement et, le cas échéant, d'intérêts dus pourraient être inférieurs aux montants de remboursement et, le cas échéant, d'intérêts initialement anticipés et les investisseurs pourraient perdre tout ou partie de leur investissement.

1. Veuillez vous référer au tableau récapitulant les principales caractéristiques financières en page 10 pour le détail des dates.
2. Hors frais, commissions, et hors fiscalité et prélèvements sociaux applicables, sous réserve de l'absence de défaut, d'ouverture d'une procédure de résolution et de faillite de l'Émetteur et du Garant et de la conservation du titre de créance jusqu'à son remboursement final. En cas de sortie en cours de vie alors que les conditions du remboursement automatique ne sont pas réunies, le montant remboursé dépendra des paramètres de marché en vigueur et engendrera un gain ou une perte non mesurable a priori. La perte en capital, notamment, pourra être partielle ou totale.

. Détail du mécanisme de remboursement_

Mécanisme de remboursement automatique anticipé possible dès la fin du 7e trimestre_

De la fin du 7e trimestre à la fin du 39e trimestre, si à une Date d'Observation Trimestrielle, le niveau de l'Indice est supérieur ou égal à son Niveau Initial, un mécanisme de remboursement automatique anticipé est activé, et l'investisseur reçoit[1] à la Date de Remboursement Automatique Anticipé correspondante :

Le Capital Initial
+
Un gain de 4,00 % par trimestre écoulé, soit 16,00 % par année écoulée

soit un TRA brut[2] maximum de 14,75 %[4]
soit un TRA net[3] maximum de 13,60 %[4]

Dès qu'un remboursement automatique anticipé est réalisé Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 s'arrête ; sinon le titre de créance continue.

À noter_ L'activation du mécanisme automatique de remboursement anticipé (possible de la fin du 7etrimestre à la fin du 39e trimestre) entraîne la dissolution du titre de créance. Si à une Date d'Observation Trimestrielle, le niveau de l'Indice clôture à un niveau strictement inférieur à son Niveau Initial, alors le mécanisme automatique de remboursement anticipé n'est pas activé et Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 se poursuit jusqu'à la prochaine Date d'Observation Trimestrielle.

Mécanisme de remboursement à l'échéance_

À la Date d'Observation Finale, le 25 août 2032, si le mécanisme de remboursement automatique anticipé n'a pas été précédemment activé, on observe le niveau de clôture de l'Indice par rapport à son Niveau Initial.

Cas favorable : Si le niveau de clôture de l'Indice est supérieur ou égal à son Niveau Initial, l'investisseur reçoit[1] le 8 septembre 2032 :

Le Capital Initial
+
Un gain final de 160,00 %, soit 16,00 % par année écoulée

soit un TRA brut[2] de 9,98 %
soit un TRA net[3] de 8,88 %

Cas médian : Si le niveau de clôture de l'Indice est supérieur ou égal à 60 % de son Niveau Initial mais strictement inférieur à son Niveau Initial, l'investisseur reçoit[1] le 8 septembre 2032 :

Le Capital Initial

soit un TRA brut[2] de 0,00 %
soit un TRA net[3] de -1,00 %

Cas défavorable : Si le niveau de clôture de l'Indice est strictement inférieur à 60 % de son Niveau Initial, l'investisseur subit une perte en capital et reçoit[1] le 8 septembre 2032 :

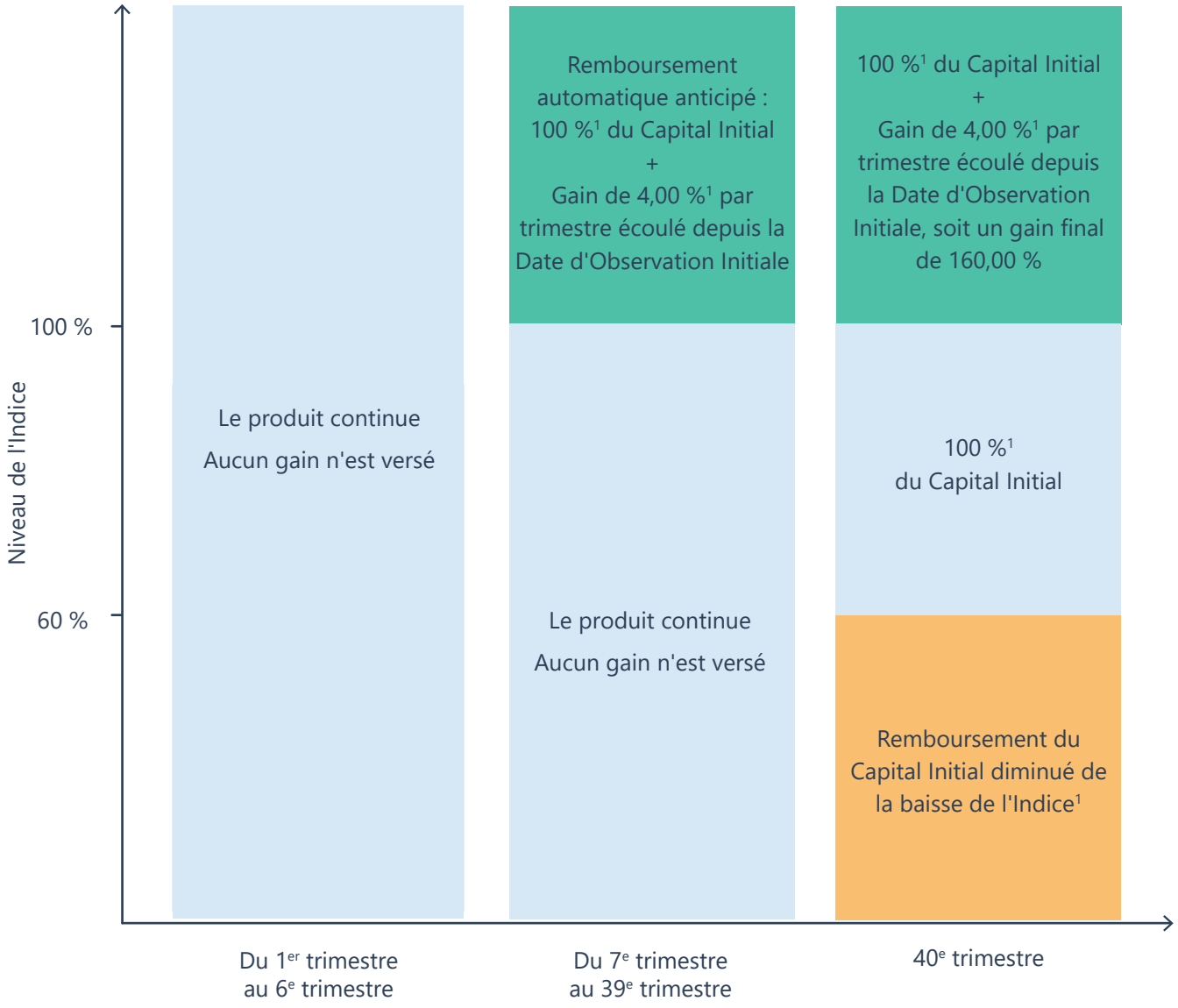
Le Capital Initial diminué de la performance négative de l'Indice

Dans ce scénario, l'investisseur subit une perte en capital à hauteur de l'intégralité de la baisse du niveau de l'Indice. Cette perte en capital peut être partielle ou totale.

1. Hors frais, commissions, et hors fiscalité et prélèvements sociaux applicables, sous réserve de l'absence de défaut, d'ouverture d'une procédure de résolution et de faillite de l'Émetteur et du Garant et de la conservation du titre de créance jusqu'à son remboursement final.
2. Dans l'ensemble des scénarios présentés ci-dessus, TRA brut désigne le Taux de Rendement Annuel brut hors commission de souscription ou frais d'entrée, de rachat, d'arbitrage et de gestion liés, le cas échéant, au contrat d'assurance-vie, de capitalisation ou au compte-titres, et/ou fiscalité et prélèvements sociaux applicables.
3. Dans l'ensemble des scénarios présentés ci-dessus, TRA net désigne le Taux de Rendement Annuel net (calculé net de frais de gestion dans le cadre d'un contrat d'assurance-vie ou de capitalisation, ou net de droit de garde dans le cas d'un investissement en compte-titres ; en prenant comme hypothèse un taux de frais de gestion de 1 % par an, et calculé hors prélèvements fiscaux et sociaux).
4. Sur la base d'un scénario correspondant au versement d'un gain de 28 % à la 1er Date de Remboursement Automatique Anticipé (le 10 juin 2024).

. Détail du mécanisme de remboursement_

Illustration du mécanisme_



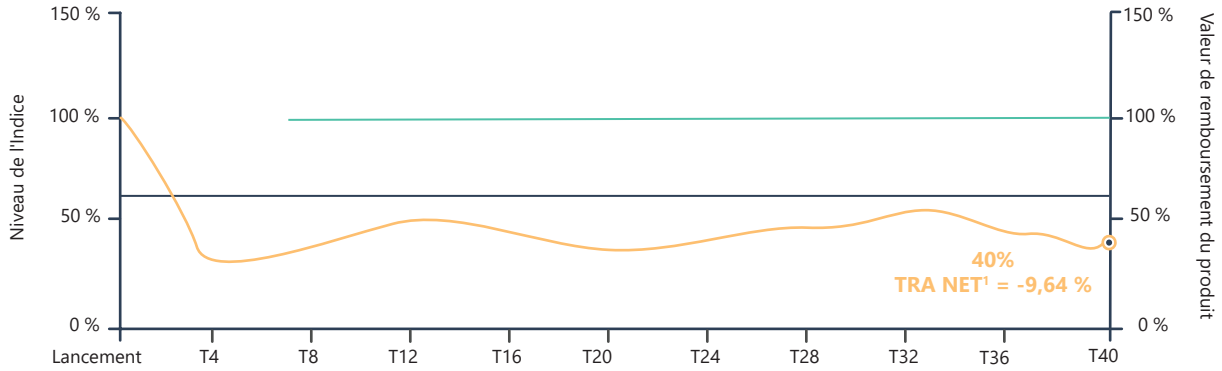
1. Hors frais, commissions, et hors fiscalité et prélèvements sociaux applicables, sous réserve de l'absence de défaut, d'ouverture d'une procédure de résolution et de faillite de l'Émetteur et du Garant et de la conservation du titre de créance jusqu'à son remboursement final.

. Illustrations_

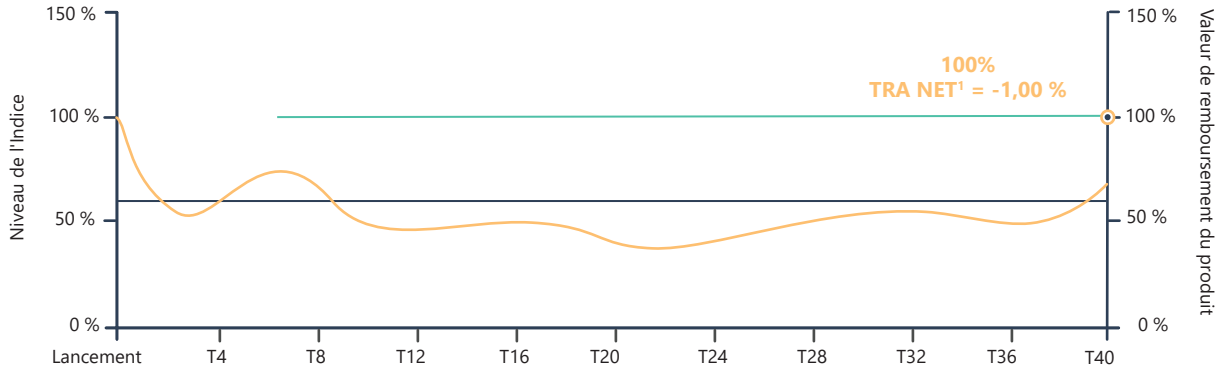
Les données chiffrées utilisées dans ces exemples n'ont qu'une valeur indicative et informative, l'objectif étant de décrire le mécanisme du titre de créance. Elles ne préjugent en rien de résultats futurs. L'ensemble des données est présenté hors fiscalité et/ou frais liés au cadre d'investissement.

- Seuil de perte en capital à l'échéance (60 % du Niveau initial de l'Indice)
- Valeur de remboursement du titre de créance
- Seuil de déclenchement du mécanisme de remboursement avec gain (100 % du Niveau initial de l'Indice)
- Evolution de l'Indice
- Mécanisme de plafonnement du gain

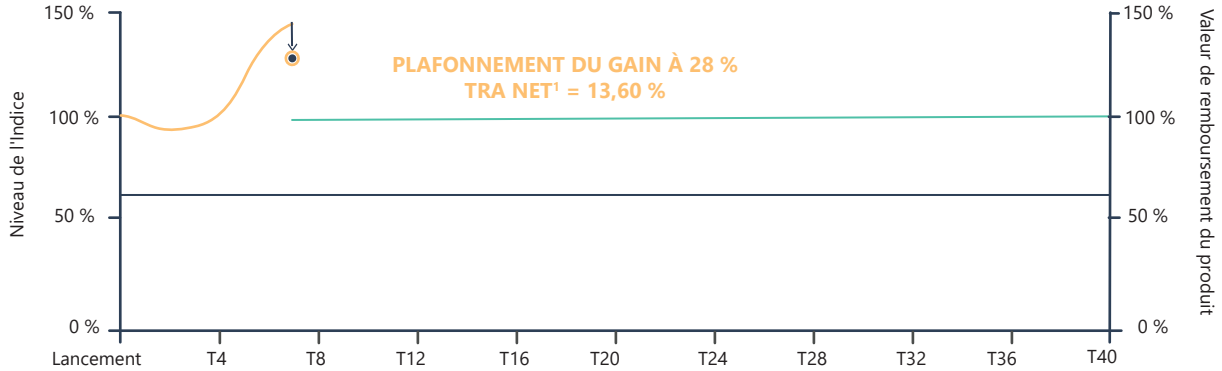
Scénario défavorable : Marché fortement baissier à long terme_



Scénario intermédiaire : Marché modérément baissier à long terme_



Scénario favorable : Marché haussier à court terme_



1. Dans l'ensemble des scénarios présentés ci-dessus, TRA net désigne le Taux de Rendement Annuel net (calculé net de frais de gestion dans le cadre d'un contrat d'assurance-vie ou de capitalisation, ou net de droit de garde dans le cas d'un investissement en compte-titres ; en prenant comme hypothèse un taux de frais de gestion de 1 % par an, et calculé hors prélèvements fiscaux et sociaux).

. Illustrations_

Les données chiffrées utilisées dans ces exemples n'ont qu'une valeur indicative et informative, l'objectif étant de décrire le mécanisme du titre de créance. Elles ne préjugent en rien de résultats futurs. L'ensemble des données est présenté hors fiscalité et/ou frais liés au cadre d'investissement.

Scénario défavorable : Marché fortement baissier à long terme_

- À chaque Date d'Observation Trimestrielle[1], le niveau de l'Indice est strictement inférieur à son Niveau Initial. Le mécanisme de remboursement automatique anticipé n'est pas activé.
- À la Date d'Observation Finale[1], le niveau de l'Indice est égal à 40 % de son Niveau Initial (soit une baisse de 60 %) : l'investisseur reçoit 40 % de son Capital Initial et subit dans ce scénario une perte en capital équivalente à celle du niveau de l'Indice, soit une perte de 60 %.
- Dans le cas défavorable où le niveau de l'Indice baisserait de plus de 40 % à la Date d'Observation Finale, la perte en capital serait supérieure à 40 % du capital investi, voire totale et le montant remboursé nul dans le cas le plus défavorable.

Remboursement final : 40 % du Capital Initial
TRA brut[2] : -8,72 % (identique à celui de l'Indice)
TRA net[3] : -9,64 %

Scénario intermédiaire : Marché modérément baissier à long terme_

- À chaque Date d'Observation Trimestrielle[1], le niveau de l'Indice est strictement inférieur à son Niveau Initial. Le mécanisme de remboursement automatique anticipé n'est pas activé.
- À la Date d'Observation Finale[1], le niveau de l'Indice est égal à 65 % de son Niveau Initial (soit une baisse de 35 %) : l'investisseur récupère l'intégralité de son Capital Initial. Dans ce scénario, l'investisseur n'est pas impacté par la baisse du niveau de l'Indice à l'échéance.

Remboursement final : 100 % du Capital Initial
TRA brut[2] : 0,00 % (contre -4,20 % pour l'Indice)
TRA net[3] : -1,00 %

Scénario favorable : Marché haussier à court terme_

- À la 1re Date d'Observation Trimestrielle[1], le niveau de l'Indice est égal à 140 % de son Niveau Initial, le mécanisme de remboursement automatique anticipé est activé et l'investisseur reçoit son Capital Initial augmenté d'un gain de 28,00 % au titre des 7 trimestres écoulés. Dans ce scénario, l'investisseur ne bénéficie que partiellement de la hausse du niveau de l'Indice (Effet de Plafonnement du Gain).

Remboursement final : 128,00 % du Capital Initial
TRA brut[2] : 14,75 % (contre 20,62 % pour l'Indice)
TRA net[3] : 13,60 %

Information importante_ la valorisation de Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 en cours de vie peut évoluer indépendamment du niveau de l'Indice et connaître de fortes fluctuations en particulier aux Dates d'Observation Trimestrielle, si le niveau de l'Indice est proche de son Niveau Initial, et à la Date d'Observation Finale, s'il est proche de 60 % et de son Niveau Initial. Elle dépend de l'évolution des paramètres de marché, en particulier du niveau et de la volatilité de l'Indice, des taux d'intérêt et des conditions de refinancement de l'Émetteur et du Garant.

1. Veuillez vous référer au tableau récapitulant les principales caractéristiques financières en page 10 pour le détail des dates.
2. Dans l'ensemble des scénarios présentés ci-dessus, TRA brut désigne le Taux de Rendement Annuel brut hors commission de souscription ou frais d'entrée, de rachat, d'arbitrage et de gestion liés, le cas échéant, au contrat d'assurance-vie, de capitalisation ou au compte-titres, et/ou fiscalité et prélèvements sociaux applicables.
3. Dans l'ensemble des scénarios présentés ci-dessus, TRA net désigne le Taux de Rendement Annuel net (calculé net de frais de gestion dans le cadre d'un contrat d'assurance-vie ou de capitalisation, ou net de droit de garde dans le cas d'un investissement en compte-titres ; en prenant comme hypothèse un taux de frais de gestion de 1 % par an, et calculé hors prélèvements fiscaux et sociaux).

. Présentation du sous-jacent_

Description de l'indice IEdge Europe Climate EW 40 Decrement 50 Points GTR®_

L'Indice **iEdge Europe Climate Equal Weight 40 Decrement 50 points GTR®** est un indice calculé et administré par SGX®. Il a été lancé le 1er octobre 2020 en collaboration avec Carbone 4, expert et référent dans la stratégie de réduction de l'empreinte carbone. L'Indice est composé de 40 valeurs de la zone euro dont les émetteurs ont la meilleure notation "Climat" telle que définie par Carbone 4. Ces 40 valeurs de l'Indice sont équipondérées.

Ainsi, les valeurs composant l'Indice iEdge Europe Climate Equal Weight 40 Decrement 50 points GTR sont engagées dans la réduction des émissions carbone soit à travers la baisse de l'intensité carbone de leur mix énergétique, la diminution de l'intensité carbone de leurs procédés industriels ou par le développement de solutions innovantes réduisant l'empreinte carbone de leurs produits ou services. Sa composition est revue à une fréquence semestrielle.

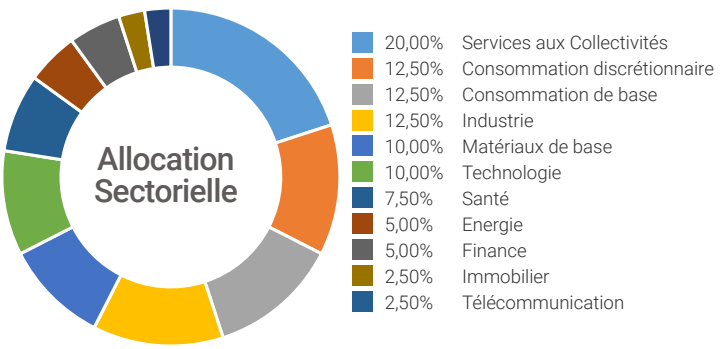
L'indice est calculé de la façon suivante : en ajoutant tous les dividendes bruts (versés par les actions composant l'Indice au fil de l'eau tout le long de la vie du produit) puis en soustrayant 50 points d'indice par an. Le montant de 50 points d'indice est fixe, et correspond au niveau médian des dividendes observés lors des années précédentes. Ce montant forfaitaire sert à éliminer les incertitudes liées au montant du dividende futur ainsi qu'à améliorer le pricing des solutions d'investissement. Si les dividendes distribués sont inférieurs (respectivement supérieurs) au niveau de prélèvement forfaitaire, la performance de l'Indice en sera pénalisée (respectivement améliorée) par rapport à un indice dividendes non réinvestis classique. **Les montants des dividendes passés ne préjugent pas des montants des dividendes futurs.**

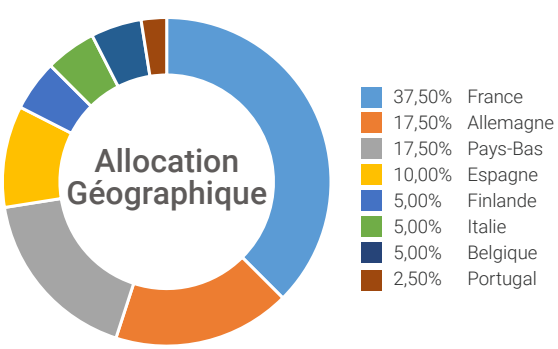
Pour de plus amples informations sur l'Indice, consulter le site https://www.sgx.com/indices/products/climatdg ou la page en français (https://equityderivatives.natixis.com/fr/indice/climatdg-sgxia0000363/) dédiée à l'Indice sur le site de Natixis, ainsi que différents sites d'informations financières (ticker Bloomberg : CLIMATDG Index).

Liste des 40 valeurs composant l'Indice_

AIR LIQUIDE SA
ALSTOM SA
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV
ASM INTERNATIONAL NV
ASML HOLDING NV
ATOS
BAYER AG
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG
CAP GEMINI SA
CONTINENTAL AG
DANONE
DEUTSCHE POST AG
EDF SA
EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA
ENDESA SA
ENEL SPA
ENGIE SA
FORTUM OYJ
FRESENIUS SE & CO KGAA
HEINEKEN NV
IBERDROLA SA
IMCD NV
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIR
KBC GROUP NV
KONINKLIJKE DSM NV
KONINKLIJKE PHILIPS NV
LEGRAND SA
ORANGE SA
PERNOD-RICARD SA
RENAULT SA
SCHNEIDER ELECTRIC SE
SIEMENS ENERGY AG
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY
SOCIÉTÉ GÉNÉRALE
STELLANTIS NV
SYMRISE AG
THALES SA
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD
UPM-KYMMENE OYJ
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA

Répartition sectorielle et géographique de l'Indice_





Sources : Bloomberg, SGX, dernier rebalancement au 28 mars 2022.

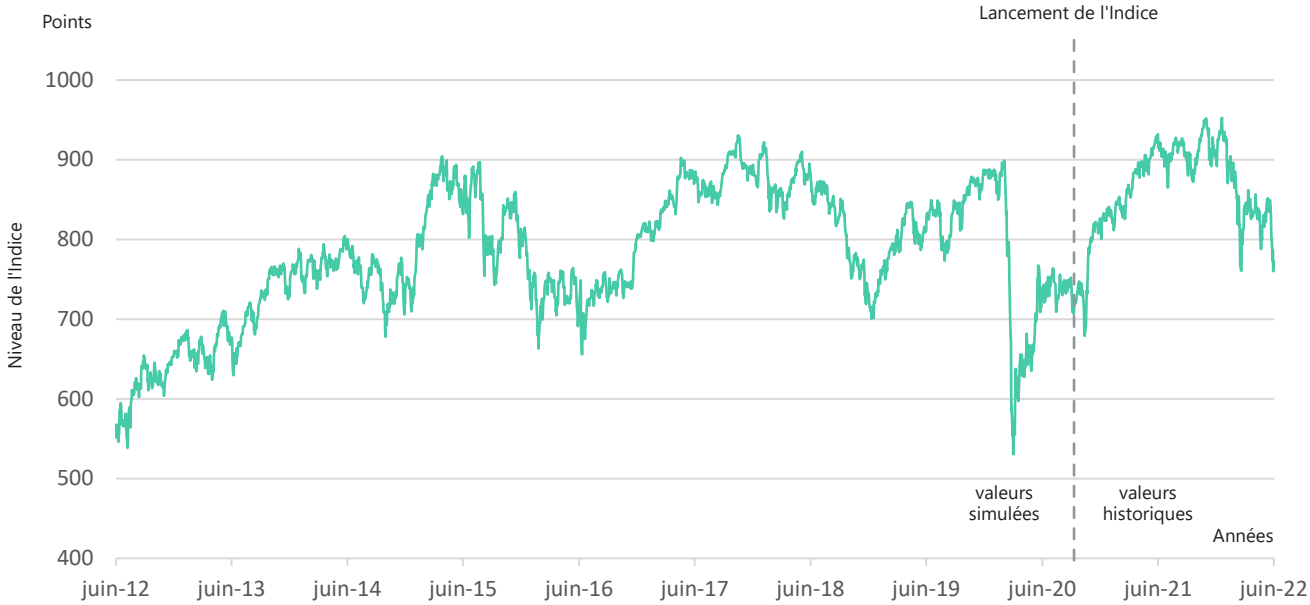
. Présentation du sous-jacent_

Évolution historique et simulée de l'indice iEdge Europe Climate EW 40 Decrement 50 Points GTR_

L'indice iEdge Europe Climate EW 40 Decrement 50 Points GTR a été lancé le 1er octobre 2020. Toutes les données précédant la date de lancement de l'Indice sont le résultat de simulations historiques systématiques visant à reproduire le comportement qu'aurait eu l'Indice s'il avait été lancé dans le passé.

Les données relatives aux performances passées et/ou simulations de performances passées ont trait ou se réfèrent à des périodes passées et ne sont pas un indicateur fiable des résultats futurs. Ceci est valable également pour les données historiques de marché.

L'exactitude, l'exhaustivité ou la pertinence de l'information provenant de sources externes ne sont pas garanties, bien qu'elles aient été obtenues auprès de sources raisonnablement jugées fiables. Sous réserve des lois applicables, Natixis n'assume pas de responsabilité à cet égard. Les éléments du présent document relatifs aux données de marché sont fournis sur la base de données constatées à un moment précis et qui sont susceptibles de varier.



Performances historiques et simulées

1 an	3 ans	5 ans	10 ans
-15,53%	-6,71%	-12,71%	40,08%

Source : Bloomberg, données du 18 juin 2012 au 18 juin 2022.

. Principales caractéristiques financières_

Type	Titre de créance complexe présentant un risque de perte en capital en cours de vie et à l'échéance, émis sous le Propectus de Base relatif au programme d'émission des Instruments Financiers, ayant été approuvé le 10 juin 2022 par l'AMF sous le visa n° 22-203.
Émetteur	Natixis Structured Issuance SA (bien que bénéficiant de la garantie inconditionnelle et irrévocable de Natixis, les titres de créance de l'Émetteur présentent un risque de perte en capital).
Garant	Natixis (S&P : A/Moody's : A1/Fitch Ratings : A+ au moment de la rédaction de la brochure). Ces notations peuvent être révisées à tout moment par les agences de notation.
Garantie en Capital	Pas de garantie en capital, ni au cours de vie ni à l'échéance.
Devise	Euro (€)
Code ISIN	FR001400BEI2
Sous-jacent	iEdge Europe Climate EW 40 Decrement 50 Points GTR® (code Bloomberg : CLIMATDG Index), indice avec décrément calculé dividendes bruts réinvestis, diminué de 50 points d'indice par an.
Éligibilité	Contrats d'assurance-vie ou de capitalisation, comptes-titres.
Prix d'émission	100 % de la Valeur Nominale
Période de commercialisation	Du 7 juillet 2022 (09H00 CET) au 25 août 2022 (17H00 CET)
Durée d'investissement conseillée	10 ans
Valeur nominale	1 000 €
Date d'Émission	7 juillet 2022
Date d'Observation Initiale	25 août 2022
Dates d'Observation Trimestrielle	Le 25 de chaque trimestre, ou le Jour de Bourse suivant si le 25 du trimestre n'est pas un Jour de Bourse, à partir du 27 mai 2024 (inclus) et jusqu'au 25 mai 2032 (inclus). Un Jour de Bourse est défini comme un jour où le niveau de clôture de l'Indice est publié. Toutes les dates peuvent faire l'objet d'ajustements en cas de jours non ouvrés.
Dates de Remboursement Automatique Anticipé éventuelles	Le 10e Jour de Bourse suivant la date d'Observation Trimestrielle, à partir du 10 juin 2024 (inclus) et jusqu'au 8 juin 2032 (inclus) Un Jour de Bourse est défini comme un jour où le niveau de clôture de l'Indice est publié. Toutes les dates peuvent faire l'objet d'ajustements en cas de jours non ouvrés.
Date d'Observation Finale	25 août 2032
Date d'Échéance	8 septembre 2032
Barrière de remboursement automatique anticipé	100 % du Niveau intial de l'Indice
Barriere de perte en capital à échéance	60 % du Niveau initial de l'Indice
Cotation	Bourse de Luxembourg
Règlement	Euroclear France
Marché secondaire	NATIXIS pourra fournir un prix indicatif des titre de créance aux porteurs qui le demanderaient. La différence entre le prix d'achat et le prix de vente ne pourra excéder 1%.
Commission de distribution	La commission de distribution ponctuelle pourra atteindre un montant maximum annuel de 1,00% du montant nominal des titres de créance placés, calculée sur la durée de vie maximale des titres.
Agent de calcul	Natixis, ce qui peut être source de conflits d'intérêt.
Publication de la valorisation	La valorisation est tenue et publiée tous les jours, et se trouve à la disposition du public en permanence sur une page publique du site de l'Émetteur (equityderivatives.natixis.com) et sur les pages d'information financière de Bloomberg, Reuters et Six Telekurs.
Double valorisation	Une double valorisation est établie par Refinitiv sur fréquence bi-mensuelle. Cette société est un organisme indépendant distinct et non lié financièrement à une entité de Natixis.

. Avertissement_

AVERTISSEMENT

Document communiqué à l'AMF conformément à l'article 212-28 de son Règlement Général. Ce document à caractère promotionnel est rédigé par l'Émetteur en accord avec Silex Finance, Silex Finance qui commercialise directement ou via des sous-distributeurs, le titre de créance Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16. Une information complète sur le titre de créance, notamment ses facteurs de risques, ne peut être obtenue qu'en lisant le Prospectus de Base (le « Prospectus ») et les Conditions Définitives.

Ce document constitue une présentation commerciale à caractère purement informatif. Il ne saurait en aucun cas constituer un conseil en investissement, un conseil, une sollicitation ou une offre en vue de l'achat ou de la vente ou de la souscription du titre de créance décrit. Il est diffusé au public, indifféremment de la personne qui en est destinataire. Ainsi le titre de créance présenté ne prend pas en compte les objectifs d'investissement, la situation financière ou les besoins spécifiques d'un destinataire en particulier. En cas de souscription, l'investisseur doit obligatoirement consulter préalablement le Prospectus de Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 afin notamment de prendre connaissance de manière exacte des risques encourus. L'investissement doit s'effectuer en fonction de ses objectifs d'investissement, son horizon d'investissement, son expérience et sa capacité à faire face au risque lié à la transaction. L'investisseur est invité, s'il le juge nécessaire, à consulter ses propres conseils juridiques, fiscaux, financiers, comptables et tout autre professionnel compétent, afin de s'assurer que ce titre de créance complexe est conforme à ses besoins au regard de sa situation, notamment financière, juridique, fiscale ou comptable. L'attention de l'investisseur est attirée sur le fait que la souscription à ce support financier peut faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou de certains pays en vertu des règlementations nationales applicables à ces personnes. IL VOUS APPARTIENT DONC DE VOUS ASSURER QUE VOUS ÊTES AUTORISÉS À SOUSCRIRE À CE TITRE DE CRÉANCE. Il conviendrait de préciser que les titres décrits aux présentes ne peuvent à aucun moment être la propriété légale ou effective d'une « US person » au sens défini dans la Régulation S, et par voie de conséquence sont offertes et vendus hors des États-Unis à des personnes qui ne sont pas ressortissantes des États-Unis sur le fondement de la Régulation S. Les simulations et opinions présentées sur ce document sont le résultat d'analyses de Natixis à un moment donné et ne préjugent en rien de résultats futurs. Il est rappelé que les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures et ne sont pas constantes dans le temps. Maratea 21 Trimestriel Août 22 - 16 est (i) éligible pour une souscription en compte-titres et (ii) un support représentatif d'une unité de compte de contrat d'assurance-vie ou de capitalisation, tel que visé dans le Code des assurances. L'ensemble des données est présenté hors fiscalité applicable, hors inflation et/ou frais liés au cadre d'investissement. Les indications qui figurent dans le présent document, y compris la description des avantages et des inconvénients, ne préjugent pas du cadre d'investissement choisi et notamment de l'impact que les frais liés à ce cadre d'investissement peuvent avoir sur l'économie générale de l'opération pour l'investisseur. Cette brochure décrit exclusivement les caractéristiques techniques et financières du titre de créance. **Ce document est destiné à être distribué dans le cadre d'une offre au public en France. Ce support n'a pas été élaboré conformément aux dispositions règlementaires visant à promouvoir l'indépendance des analyses financières. Natixis n'est pas soumise à l'interdiction d'effectuer des transactions sur l'instrument concerné avant la diffusion de la communication.**

Natixis ou ses filiales et participations, collaborateurs ou clients peuvent avoir un intérêt ou détenir ou acquérir des informations sur tout produit, instrument financier, action ou marché mentionné dans ce document qui pourrait engendrer un conflit d'intérêt potentiel ou avéré. Cela peut impliquer des activités telles que la négociation, la détention ou l'activité de market making, ou la prestation de services financiers ou de conseil sur tout produit, instrument financier, action ou marché mentionné dans ce document. Ce document à caractère promotionnel ne constitue pas un document d'analyse financière.

INFORMATIONS IMPORTANTES

Les Titres de créance décrits dans la présente communication à caractère promotionnel font l'objet d'une documentation juridique composée (https://cib.natixis.com/home/pims/prospectus#/prospectusPublic) du prospectus de base relatif au programme d'émission des Instruments Financiers, tel que modifié par ses suppléments successifs, approuvé le 10 juin 2022 par l'AMF sous le n° 22-203 (le « Prospectus de Base ») et des conditions définitives en date du 5 juillet 2022 (les « Conditions Définitives ») formant ensemble un prospectus conforme au réglement 2017/1129 (réglement prospectus) tel qu'amendé. Le Prospectus de Base et les Conditions Définitives sont disponibles sur le site internet de la Bourse de Luxembourg (www.bourse.lu), le site internet de Natixis (https://cib.natixis.com/DevInet.PIMS.ComplianceTool.Web/api/ProspectusPublicNg/DownloadDocument/236/PROGRAM_SEARCH https://cib.natixis.com/devinet.pims.compliancetool.web/api/ProspectusPublicNg/Download/FR001400BEI2/FT/DS), de l'AMF (www.amf-france.org) et sont disponibles pour consultation auprès de Natixis 47, quai d'Austerlitz, 75013 Paris. L'approbation du Prospectus de Base par l'AMF ne doit pas être considérée comme un avis favorable sur les valeurs mobilières offertes ou admises à la négociation sur un marché réglementé. Les informations figurant dans ce document n'ont pas vocation à faire l'objet d'une mise à jour après la date d'ouverture de la période de commercialisation. Par ailleurs, la remise de ce document n'entraîne en aucune manière une obligation implicite de quiconque de mise à jour des informations qui y figurent. Ce document ne peut être distribué directement ou indirectement à des citoyens ou résidents des États-Unis. Natixis est agréée par l'Autorité de Contrôle Prudentiel et de Résolution (« ACPR ») en France en qualité de Banque – prestataire de services d'investissements. Natixis est réglementée par l'AMF pour l'exercice des services d'investissements pour lesquels elle est agréée. Natixis est supervisée par la Banque Centrale Européenne (« BCE »).

AVERTISSEMENT SGX

Singapore Exchange Limited et/ou ses sociétés affiliées (collectivement, « SGX ») ne donne aucune garantie ou représentation, expresse ou implicite, quant aux résultats à obtenir de l'utilisation de l'indice iEdge Europe Climate EW 40 Decrement 50 Points GTR® (« l'Indice ») et/ou du niveau auquel l'Indice se situe à un moment donné, un jour donné ou autre. L'Indice est calculé et administré par SGX. SGX ne sera pas responsable (que ce soit par négligence ou autrement) et ne sera pas tenu d'informer d'une quelconque erreur dans le présent document. L'Indice est une marque commerciale de SGX et est utilisée par Natixis sous licence. Tous les droits de propriété intellectuelle dans l'Indice sont dévolus à SGX.



www.silex-partners.com

PARIS **GENÈVE** **ZURICH** **LUGANO** **LUXEMBOURG** **MONACO**

SILEX Finance 32 rue de Monceau, 75008 PARIS t. +33 1 83 75 72 77 mail. silexfi@silex-partners.com

Disclaimer
Le présent document contient des informations essentielles sur le produit d´investissement. Ces informations vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste ce produit et quels risques, coûts, gains et pertes potentiels y sont associés, et de vous aider à le comparer à d´autres produits.
Le destinataire ne doit ni diffuser, ni modifier, ni copier/plagier, ni agir en s'appuyant sur ce document, sans autorisation préalable de SILEX Finance. En ce qui concerne le présent document, ni SILEX Finance, ni aucun de ses salariés ou représentants, ne donne de garantie ou de déclaration, expresse ou implicite, ni n'assume aucune responsabilité juridique, ni n'assume aucune responsabilité quant à l'exactitude, l'exhaustivité ou l'utilité des informations communiquées. Ni SILEX Finance ni aucun de ses salariés ou représentants n'assume aucune responsabilité de quelque nature que ce soit résultant de toute mesure prise en se fondant sur ce document. Ce contenu n'est pas destiné à être une sollicitation ni une offre de service, il a uniquement pour objet d'informer les investisseurs professionnels. La préparation des informations fournies dans le présent document se fait avec un niveau élevé de soins. Néanmoins, des erreurs sont possibles. Le destinataire de ce document est invité à s'enquérir des conseils de professionnels afin de discuter des risques encourus avec les entreprises décrites dans ce document. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Les références à certains titres et instruments financiers sont données à titre d'illustration uniquement. SILEX Finance suppose que tous les utilisateurs comprennent les risques liés aux activités décrites dans le présent document. SILEX Finance se réserve le droit de modifier à tout moment le contenu et les termes de ce document. Tous droits réservés.
En accord avec le Règlement Général sur la Protection des Données (RGPD – règlement UE 2016/679), en application depuis le 25 mai 2018, vous avez le droit d'accéder, de modifier, de porter, d'effacer le traitement de vos données ou d'en limiter leur traitement.
Vous avez un droit d'opposition au traitement de vos données personnelles et avez le droit de retirer votre consentement au traitement de vos données à chaque instant.
Date de rédaction de la brochure : 27 juin 2022