

### ZWECK

Dieses Informationsblatt stellt Ihnen wesentliche Informationen über dieses Anlageprodukt zur Verfügung. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen dabei zu helfen, die Art, das Risiko, die Kosten sowie die möglichen Gewinne und Verluste dieses Produkts zu verstehen, um Ihnen dabei zu helfen, es mit anderen Produkten zu vergleichen.

### PRODUKT

|   |  |
|---|--|
| <b>PRODUKTBEZEICHNUNG</b>                       | <b>CALL WARRANTS AUF MODERNA INC</b>   |
| <b>PRODUKTKENNUNGEN</b>                         | ISIN: CH1111719907; Valor: 111171990 ; Symbol: MRZDJB  |
| <b>PRIIP-HERSTELLER</b>                         | Bank Julius Baer & Co. Ltd, Zürich ( <a href="https://derivatives.juliusbaer.com/en/home">https://derivatives.juliusbaer.com/en/home</a> )<br>Weitere Informationen telefonisch unter +41 (0)58 888 8181   |
| <b>ZUSTÄNDIGE BEHÖRDE DES PRIIP-HERSTELLERS</b> | Eidgenössische Finanzmarktaufsicht der Schweiz (FINMA) – Die FINMA wird nicht als zuständige Aufsichtsbehörde gemäß EU-Verordnung 1286/2014 über Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte (PRIIP) im technischen Sinne erachtet, da die Schweiz nicht Mitglied der EU ist. |
| <b>DATUM UND ZEITPUNKT DER ERSTELLUNG</b>       | 16. September 2021 07:03:30 MEZ  |

**SIE SIND IM BEGRIFF, EIN PRODUKT ZU ERWERBEN, DAS NICHT EINFACH IST UND SCHWER ZU VERSTEHEN SEIN KANN.**

### UM WELCHE ART VON PRODUKT HANDELT ES SICH?

|                                |  |  |
|--------------------------------|--|--|
| <b>Emissionswährung</b>        | CHF  |  |
| <b>Ausübungswährung</b>        | USD  | telbar darauffolgende Börsenhandelstag als Verfalltag. |
| <b>Emissionspreis</b>          | CHF 0.24   | Planmässiger Handelsschluss                            |
| <b>Ausübungsstil</b>           | Amerikanisch   |  |
| <b>Anfängliche Volatilität</b> | 55.17%   |  |
| <b>Anfängliches Delta</b>      | 36.87%   |  |
| <b>Anfängliches Gearing</b>    | 8.13x  |  |
| <b>Anfängliche Prämie</b>      | 73.42%   |  |
| <b>Auflegungstag</b>           | 10. Juni 2021  |  |
| <b>Emissionstag</b>            | 11. Juni 2021  |  |
| <b>Ausübungsfrist</b>          | von 10. Juni 2021 bis 16. Dezember 2022  |  |
| <b>Ausübungstag</b>            | in Bezug auf irgendein Produkt, der Börsenhandelstag während der Ausübungsfrist, in der ein derartiges Produkt ausgeübt wird.                    |  |
| <b>Ausübungsgröße</b>          | 100 Produkte und das Vielfache derselben, wobei dies der Mindestanzahl von Produkten entspricht, die zur Ausübung des Produkts erforderlich ist. |  |
| <b>Verfalltag</b>              | 16. Dezember 2022 - Handelt es sich dabei nicht um einen Börsenhandelstag, dann gilt der unmit-  |  |

### BASISWERT

| Bezeichnung | ISIN         | Anfangskurs | Ausübungspreis/Referenzkurs | Referenzquelle                    |
|-------------|--------------|-------------|-----------------------------|-----------------------------------|
| Moderna Inc | US60770K1079 | USD 217.23  | USD 350.00                  | Nasdaq/Ngs (Global Select Market) |

**ART:** Schuldtitel nach Schweizer Recht.

**ZIEL:** Call Warrants sind Produkte mit Hebelwirkung und ermöglichen es Ihnen durch den Hebel zu profitieren, von einem Anstieg des Werts des Basiswerts. Aufgrund der Hebeleigenschaft der Produkte kann ein geringer investierter Betrag höhere Renditen liefern, aber auch zu höheren Verlusten führen, als es jeweils in den Gewinnen und Verlusten des Basiswerts wiedergespiegelt werden wird.

Die Anzahl der Produkte, wie im Bezugsverhältnis angegeben, verleihen Ihnen das Recht bei Ausübung zu erhalten einen Barbetrag in der Abrechnungswährung vom Hersteller vorausgesetzt, dass bei der Ausübung der Wert des Basiswerts **über** dem Ausübungspreis/Referenzkurs liegt. Wenn also der Wert des Basiswerts bei Ausübung über dem Ausübungspreis/Referenzkurs liegt, werden Sie, mit Hebelwirkung, von einem Anstieg des Wert des Basiswerts in Form einer Barbezahlung profitieren der in Abhängigkeit von der positiven Wertentwicklung des Basiswerts zunimmt. Damit entspricht die potenzielle Rendite des Produkts der Differenz zwischen dem Wert des Basiswerts am Abwicklungstag und dem Ausübungspreis/Referenzkurs. Alternativ gilt: Wenn die Produkte nicht bereits vorher ausgeübt wurden und der Wert des Basiswerts nach Ende der Laufzeit **auf oder unter** dem Ausübungspreis/Referenzkurs liegt, verlieren Sie Ihre Investition vollständig.

**AUSÜBUNGSRECHT:** Soweit nicht bereits eine Rückzahlung, ein Rückkauf oder eine Kündigung erfolgt ist, berechtigt Sie die Anzahl der im Bezugsverhältnis angegebenen Produkte bei Ausübung während der Ausübungsfrist am Erfüllungstag zu erhalten vom Hersteller einen Barbetrag in der Abrechnungswährung größeren Wert von (i) Null (0) und (ii) dem Kurs am offiziellen Börsenschluss am jeweiligen Ausübungstag abzüglich dem Ausübungspreis/Referenzkurs. Produkte, die bis Laufzeitende am Verfalltag nicht ausgeübt wurden, werden automatisch von der Zahlstelle (unter Berücksichtigung der Ausübungsgröße) ausgeübt, wenn nach einer solchen Ausübung an Sie ein Betrag zu zahlen ist, d. h., wenn das Produkt „in-the-money“ ist.

**AUSÜBUNGSBEDINGUNGEN:** Die Produkte können nur in einer Zahl ausgeübt werden, die der Ausübungsgröße oder einem Vielfachen davon entspricht, an jedem Börsenhandelstag während der Ausübungsfrist ausgeübt werden. Eine Ausübungsmitteilung ist von Ihnen zusammen mit den jeweiligen Produkten an die angegebene Niederlassung zu übermitteln. Eine Feststellung des Herstellers, ob eine Ausübungsmitteilung vollständig ist oder in ordnungsgemäßer Form vorliegt oder rechtzeitig eingereicht wurde, ist – außer in Fällen eines offensichtlichen Irrtums – bindend.

**SEKUNDÄRMARKT:** Unter Umständen hat sich bei der Begebung der Produkte noch kein Markt für diese gebildet, und möglicherweise kommt ein solcher Markt auch niemals zustande. Falls ein Markt zustande kommt, ist er unter Umständen nicht liquide. Daher werden Sie unter Umständen nicht in der Lage sein, Ihre Produkte problemlos oder zu einem für Sie hinreichend annehmbaren Preis zu verkaufen. Unter normalen Marktbedingungen wird sich der Hersteller bemühen, einen Sekundärmarkt für die Produkte zu stellen, eine rechtliche Verpflichtung dazu besteht jedoch nicht. Auf Ihr Verlangen wird sich der Hersteller bemühen, in Abhängigkeit von den jeweiligen Marktbedingungen Geld- und Briefkurse für Produkte zu stellen. Zwischen den Geld- und Briefkursen wird eine Differenz (Spread) bestehen.

Die Produktbedingungen sehen außerdem vor, dass im Fall außergewöhnlicher Ereignisse Anpassungen am Produkt vorgenommen werden können und der Produkthersteller das Produkt vorzeitig beenden kann. Diese Ereignisse sind in den Produktbedingungen angegeben und beziehen sich hauptsächlich auf die Basiswerte, das Produkt und den Produkthersteller. Anleger sollten daher darauf vorbereitet sein, einen teilweisen oder vollständigen Verlust ihrer Anlagen zu erleiden.

### KLEINANLEGERZIELGRUPPE

Das Produkt richtet sich an Kleinanleger, die alle der nachstehenden Kriterien erfüllen:

- Verfügen über ausreichende Kenntnisse und Erfahrung sowie ein umfassendes Verständnis des Produkts, des jeweiligen Marktes und dessen spezifische Risiken, entweder eigenständig oder durch professionelle Beratung.
- Sie streben einen Ertrag an, gehen davon aus, dass sich der Basiswert in einer Weise entwickelt, die zu einer positiven Rendite führt, und haben einen Anlagehorizont, der der nachstehend empfohlenen Haltedauer entspricht.

- Sie akzeptieren das Risiko, dass der Hersteller nicht zahlen oder seine Verpflichtungen im Rahmen des Produkts nicht erfüllen könnte, und können einen vollständigen Verlust ihrer Anlage tragen.
- Sie sind bereit ein Risikoniveau zu akzeptieren, um potenzielle Renditen zu erzielen, die dem nachstehend aufgeführten Gesamtrisikoindikator entsprechen.

## WELCHE RISIKEN BESTEHEN UND WAS KÖNNTE ICH IM GEGENZUG DAFÜR BEKOMMEN?

### RISIKOINDIKATOR



Der Risikoindikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt bis zur Fälligkeit behalten. Wenn Sie die Anlage frühzeitig auflösen, kann das tatsächliche Risiko erheblich davon abweichen und Sie erhalten unter Umständen weniger zurück. Es kann sein, dass Sie Ihr Produkt nicht ohne Weiteres veräußern können oder dass Sie es zu einem Preis veräußern müssen, der den Betrag, den Sie zurückerhalten, erheblich schmälert.

Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risikoniveau im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass dieses Produkt aufgrund von Marktbewegungen oder des Ausfallrisikos des Herstellers Geld verliert.

Der Hersteller hat dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 7 eingestuft, wobei der höchsten Risikoklasse entspricht. Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als sehr hoch eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen ist es äußerst unwahrscheinlich, dass die Fähigkeit des Herstellers beeinträchtigt wird, Sie auszuzahlen.

Bitte beachten Sie das **Währungsrisiko**: Wenn sich die Währung Ihres Kontos von der des vorliegenden Produkts unterscheidet, sind Sie einem Währungsrisiko ausgesetzt.

Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor künftigen Marktentwicklungen, sodass Sie das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren könnten.

### PERFORMANCE-SZENARIEN

**Zukünftige Marktentwicklungen können nicht exakt vorhergesagt werden. Die dargestellten Szenarien zeigen lediglich einige mögliche Ergebnisse auf Grundlage aktueller Renditen. Die tatsächlichen Renditen können geringer ausfallen.**

Nominalbetrag: CHF 10'000

|                                 |   | 1 Jahr                          | 16. Dezember 2022<br>(Empfohlene Haltedauer) |
|---------------------------------|---|---------------------------------|--|
| <b>Stressszenario</b>           | <b>Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten</b><br>Prozentuale Rendite (annualisiert) | <b>CHF -4'740.72</b><br>-47.41% | <b>CHF -684.26</b><br>-5.44%                 |
| <b>Pessimistisches Szenario</b> | <b>Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten</b><br>Prozentuale Rendite (annualisiert) | <b>CHF -1'039.03</b><br>-10.39% | <b>CHF -684.26</b><br>-5.44%                 |
| <b>Mittleres Szenario</b>       | <b>Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten</b><br>Prozentuale Rendite (annualisiert) | <b>CHF -445.11</b><br>-4.45%    | <b>CHF -684.26</b><br>-5.44%                 |
| <b>Optimistisches Szenario</b>  | <b>Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten könnten</b><br>Prozentuale Rendite (annualisiert) | <b>CHF 14'721.16</b><br>147.21% | <b>CHF 11'880.52</b><br>85.55%               |

Diese Tabelle zeigt, wie viel Sie während der Laufzeit dieses Produkts zurückerhalten könnten, dargestellt durch verschiedene Szenarien, angenommen einen Nominalbetrag von CHF 10'000. Die dargestellten Szenarien zeigen, wie sich Ihre Anlage entwickeln könnte.

Die dargestellten Szenarien entsprechen einer Schätzung der künftigen Wertentwicklung aufgrund früherer Wertänderungen dieser Anlage; sie sind kein exakter Indikator. Wie viel Sie tatsächlich erhalten, hängt davon ab, wie sich der Markt entwickelt und wie lange Sie das Produkt halten. Das Stressszenario zeigt, was Sie im Fall extremer Marktbedingungen zurückerhalten könnten, und berücksichtigt nicht den Fall, dass der Hersteller womöglich nicht in der Lage ist, die Auszahlung vorzunehmen.

Dieses Produkt ist nicht ohne Weiteres auflösbar. Es kann sein, dass Sie es nicht vorzeitig auflösen können oder dass Ihnen bei der vorzeitigen Auflösung hohe Kosten entstehen oder ein hoher Verlust entsteht.

In den angeführten Zahlen sind sämtliche Kosten des Produkts selbst enthalten, jedoch unter Umständen nicht alle Kosten, die Sie an Ihren Berater oder Ihre Vertriebsstelle zahlen müssen. Bei den angeführten Zahlen ist Ihre persönliche steuerliche Situation nicht berücksichtigt, die sich ebenfalls darauf auswirken kann, wie viel Sie zurückerhalten.

## WAS GESCHIEHT, WENN DER HERSTELLER NICHT IN DER LAGE IST, DIE AUSZAHLUNG VORZUNEHMEN?

Sie sind dem Risiko ausgesetzt, dass der Hersteller seine Verpflichtungen im Zusammenhang mit dem Produkt beispielsweise im Falle einer Insolvenz oder einer behördlichen Anordnung von Abwicklungsmaßnahmen nicht erfüllen kann. Das kann den Wert des Produkts wesentlich nachteilig beeinflussen und könnte dazu führen, dass Sie einen teilweisen oder vollständigen Verlust Ihrer Anlage in das Produkt erleiden. Das Produkt ist keine Einlage und ist daher nicht durch ein Einlagensicherungssystem abgedeckt.

## WELCHE KOSTEN ENTSTEHEN?

Die Renditeminderung (Reduction of Yield - RIY) zeigt, wie sich die von Ihnen gezahlten Gesamtkosten auf die Anlagerendite, die Sie erhalten könnten, auswirken. In den Gesamtkosten sind einmalige, laufende und zusätzliche Kosten berücksichtigt.

Die hier ausgewiesenen Beträge entsprechen den kumulierten Kosten des Produkts bei einer Haltedauer. Sie beinhalten etwaige Vertragsstrafen bei vorzeitigem Ausstieg. Bei den angegebenen Zahlen wird davon ausgegangen einen Nominalbetrag von CHF 10'000. Die Zahlen sind Schätzungen und können in der Zukunft anders ausfallen.

### KOSTEN IM ZEITVERLAUF

| Nominalbetrag: CHF 10'000                 | Wenn Sie am Ende von 1 Jahr | Wenn Sie am Ende der empfohlenen Haltedauer einlösen |
|---|-----------------------------|--|
| Gesamtkosten                              | CHF 1.04                    | CHF 1.08   |
| Auswirkung auf die Rendite (RIY) per year | 0.01%                       | 0.01%  |

Die in vorstehender Tabelle aufgeführte Renditeminderung ist annualisiert, was bedeutet, dass sie gegebenenfalls nicht mit der Renditeminderung vergleichbar ist, die in anderen Basisinformationsblättern aufgeführt ist.

Die in vorstehender Tabelle aufgeführten Kosten zeigen auf, wie sehr sich die erwarteten Kosten des Produkts auf Ihre Rendite auswirken würden, wenn davon ausgegangen wird, dass sich das Produkt entsprechend dem mittleren Performance-Szenario entwickelt.

Die Person, die Ihnen dieses Produkt verkauft oder Sie dazu berät, kann Ihnen weitere Kosten in Rechnung stellen. Sollte dies der Fall sein, informiert Sie die Person über diese Kosten und zeigt Ihnen, wie sich sämtliche Kosten im Zeitverlauf auf Ihre Anlage auswirken werden.

### ZUSAMMENSETZUNG DER KOSTEN

Aus der nachfolgenden Tabelle geht Folgendes hervor:

- wie sich die verschiedenen Arten von Kosten auf die Anlagerendite auswirken, die Sie am Ende der empfohlenen Haltedauer erhalten könnten.
- was die verschiedenen Kostenkategorien beinhalten.

**Diese Tabelle zeigt die Auswirkungen auf die Rendite per year.**

|                  |                 |       |   |
|------------------|-----------------|-------|---|
| Einmalige Kosten | Einstiegskosten | 0.01% | Auswirkung der bereits im Preis inbegriffenen Kosten. |
|------------------|-----------------|-------|---|

|                    |                          |       |   |
|--------------------|--------------------------|-------|---|
|                    | Ausstiegskosten          | 0.00% | Auswirkung der Kosten, die anfallen, wenn Sie bei Fälligkeit aus Ihrer Anlage aussteigen. |
| Laufende Kosten    | Transaktionskosten       | -     | Auswirkung der bereits im Preis inbegriffenen Kosten.                                     |
|                    | Sonstige laufende Kosten | -     | Auswirkung der bereits im Preis inbegriffenen Kosten.                                     |
| Zusätzliche Kosten | Erfolgsgebühr            | -     | Auswirkung der bereits im Preis inbegriffenen Kosten.                                     |
|                    | Carried Interest         | -     | Auswirkung der bereits im Preis inbegriffenen Kosten.                                     |

Die in vorstehender Tabelle aufgeführten Kosten zeigen die Aufteilung der Renditeminderung, die in der Tabelle der Kosten im Zeitverlauf dargestellt ist, am Ende der empfohlenen Haltedauer. Die Aufteilung des tatsächlichen geschätzten costs per year des Produkts als Prozentsatz der Nominalbetrag wird wie folgt geschätzt: Einstiegskosten: 0.00% und Ausstiegskosten: 0,00 %.

## WIE LANGE SOLLTE ICH DIE ANLAGE HALTEN, UND KANN ICH VORZEITIG GELD ENTNEHMEN?

### Empfohlene Haltedauer: 16. Dezember 2022 (Fälligkeitstag)

Das Ziel des Produkts ist, Ihnen die oben unter „Um welche Art Produkt handelt es sich?“ beschriebene Rendite zu bieten. Dies gilt jedoch nur, sofern das Produkt bis zur Fälligkeit gehalten wird.

Eine Auflösung kann nur durch den Verkauf des Produkts entweder über die Börse (wenn das Produkt notiert ist) oder außerbörslich vollzogen werden, sofern für dieses Produkt ein Angebot besteht. Für eine solche Transaktion berechnet der Hersteller keine Gebühren oder Sanktionen, es kann jedoch gegebenenfalls eine Ausführungsgebühr seitens Ihres Maklers anfallen. Wenn Sie das Produkt vor Fälligkeit verkaufen, können Sie gegebenenfalls weniger zurückerhalten, als Sie erhalten hätten, wenn Sie das Produkt bis zur Fälligkeit gehalten hätten.

Bei volatilen oder ungewöhnlichen Marktbedingungen oder im Fall von technischen Störungen kann der Verkauf des Produkts vorübergehend behindert oder ausgesetzt bzw. überhaupt nicht möglich sein.

## WIE KANN ICH MICH BESCHWEREN?

Beschwerden über das Verhalten der Person, die zu dem Produkt berät oder es verkauft, können direkt an diese Person oder deren Vorgesetzte gerichtet werden. Beschwerden über das Produkt oder das Verhalten des Herstellers des vorliegenden Produkts können schriftlich an folgende Anschrift gerichtet werden: Bank Julius Baer & Co. Ltd., Hohlstrasse 604/606, Postfach 8010 Zürich, Schweiz, per E-Mail an: derivatives@juliusbaer.com oder über die folgende Website: <https://derivatives.juliusbaer.com/en/home>.

## SONSTIGE ZWECKDIENLICHE ANGABEN

Die in diesem Basisinformationsblatt enthaltenen Informationen stellen keine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf des Produkts dar und ersetzen nicht die individuelle Beratung durch Ihre Bank oder Ihren Berater.

Das Angebot dieses Produkt ist nicht gemäß dem US-amerikanischen Wertpapiergesetz von 1933 (Securities Act) registriert. Das Produkt darf weder direkt noch indirekt in den Vereinigten Staaten von Amerika bzw. US-Personen angeboten oder verkauft werden. Der Begriff „US-Person“ ist in Regulation S des US-Wertpapiergesetzes von 1933 in der jeweiligen gültigen Fassung definiert.

Jegliche zusätzliche Dokumentation im Zusammenhang mit dem Produkt, insbesondere die Emissionsprogrammdokumentation, sämtliche dazugehörigen Ergänzungen sowie die Produktbedingungen sind kostenlos verfügbar bei Bank Julius Baer & Co. Ltd. Hohlstrasse 604/606, Postfach, 8010 Zürich, Schweiz.

Die im vorliegenden Basisinformationsblatt (KID) dargestellten Performance-Szenarien basieren auf einer Methodik, die in der EU-Verordnung 1286/2014 über Basisinformationsblätter für verpackte Anlageprodukte für Kleinanleger und Versicherungsanlageprodukte (PRIIP) und deren ergänzenden Verordnungen festgelegt ist. Die Einhaltung der vorgeschriebenen Berechnungsmethode kann für eine Reihe von Produkten zu unrealistischen Performance-Szenarien und Werten führen.