Final Terms dated: 29 July 2026

**Leverage Shares Public Limited Company**

*(a public company incorporated with limited liability in Ireland)*

LEI: 635400TLFJSNHVSOFH59

Issue of

15000 *IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP*

pursuant to the

Collateralised Exchange Traded Securities Programme

(the "**ETP Securities**")

This document constitutes the Final Terms of the ETP Securities described herein.

The Base Prospectus referred to below (as completed by these Final Terms) has been prepared on the basis that any offer of ETP Securities in any Member State of the EEA (each, a "Relevant Member State") will be made pursuant to an exemption under the Prospectus Regulation from the requirement to publish a prospectus for offers of the ETP Securities. Accordingly, any person making or intending to make an offer in that Relevant Member State of the ETP Securities may only do so in circumstances in which no obligation arises for the Issuer or any dealer to publish a prospectus pursuant to Article 3 of the Prospectus Regulation or supplement a prospectus pursuant to Article 23 of the Prospectus Regulation, in each case, in relation to such offer. Neither the Issuer nor any dealer has authorised, nor do they authorise, the making of any offer of the ETP Securities in any other circumstances.

The Base Prospectus referred to below (as completed by these Final Terms) has been prepared on the basis that, except as provided in sub-paragraph (ii) below, any offer of ETP Securities in any Member State of the EEA (each, a "**Relevant Member State**") will be made pursuant to an exemption under the Prospectus Regulation from the requirement to publish a prospectus for offers of the ETP Securities. Accordingly any person making or intending to make an offer of the ETP Securities may only do so:

(i) in circumstances in which no obligation arises for the Issuer to publish a prospectus pursuant to Article 3 of the Prospectus Regulation or supplement a prospectus pursuant to Article 23 of the Prospectus Regulation, in each case, in relation to such offer; or

(ii) in those EU Non-exempt Offer Jurisdictions mentioned in the following paragraph, provided such person is one of the persons mentioned in the following paragraph and that such offer is made during the Offer Period specified for such purpose therein.

An offer of the ETP Securities may be made by the Issuer or by the Authorised Participant other than pursuant to Article 1 of the Prospectus Regulation in Ireland, Italy, Germany, France, Spain, the Netherlands, Poland, Belgium, Sweden, Norway and Austria ("**EU Non-exempt Offer Jurisdictions**") during the period of 12 months from the Base Prospectus Date (as defined below) (the "**Offer Period**").

The Issuer has not authorised, and does not authorise, the making of any offer of ETP Securities in any other circumstances.

The expression "Prospectus Regulation" means Regulation (EU) 2017/1129 and the expression "**Central Bank"** means the Central Bank of Ireland in its capacity as the competent authority in Ireland under the Prospectus Regulation.

## PART A – CONTRACTUAL TERMS

Terms used herein shall have the meanings given to them in the terms and conditions set forth in the Base Prospectus dated 11 June 2026, and the supplement(s) to it dated 07 July 2026 (the "**Base Prospectus**" and the "**Base Prospectus Date**") which together constitute a base prospectus for the purposes of the Prospectus Regulation. This document constitutes the Final Terms of the ETP Securities described herein and has been prepared for the purposes of Article 8 of the Prospectus Regulation and must be read in conjunction with the Base Prospectus (and any supplement thereto).
Full information on Leverage Shares Public Limited Company (the "**Issuer**") and the offer of the ETP Securities is only available on the basis of the combination of these Final Terms and the Base Prospectus. The Base Prospectus (together with any supplement thereto) is available on the website of the Issuer at https://leverageshares.com/?page_id=16514. A summary of the ETP Securities to which these Final Terms relate is included as an Annex hereto. Terms used in these Final Terms bear the same meaning as in the Base Prospectus.

The Base Prospectus dated 11 June 2026, and the supplement(s) to it dated 07 July 2026 were filed with SIX Exchange Regulation AG as review body (the "Swiss Review Body") pursuant to article 52 of the Swiss Financial Services Act of 15 June 2018, as amended (the "FinSA") for automatic recognition in accordance with article 54(2) of the FinSA as a base prospectus within the meaning of article 45 of the FinSA, and published in accordance with the FinSA. The Swiss Review Body has not reviewed or approved the Base Prospectus, and the supplement(s) to it dated 07 July 2026 or these Final Terms.

*The particulars in relation to this issue of ETP Securities are as follows:*

| | | |
|---|---|---|
| 1. | Series of ETP Securities to which these Final Terms apply: | IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP |
| 2. | Tranche: | 5 |
| 3. | Number of ETP Securities to which these Final Terms apply: | 15000 |
| 4. | Issue Date: | 29 July 2026 |
| 5. | Series Issue Date: | 19 March 2026 |
| 6. | Issue Price: | USD 4.7126 per ETP Security |
| 7. | Principal Amount: | USD 10.00 per ETP Security |
| 8. | Maximum number of ETP Securities of this Series which may be issued: | 1,000,000,000 |
| 9. | Minimum transferable number of ETP Securities: | One |
| 10. | Trading Method: | Unit |
| 11. | Relevant Currency: | USD |
| 12. | Final Redemption Date: | 19 March 2076 |
| 13. | Denomination: | Principal Amount |
| 14. | Investment Objective: | To pursue the LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy |

| | | |
|---|---|---|
| 15. | Income Series | Applicable |
| 16. | Exposure Type: | Not Applicable |
| 17. | Leverage Factor: | Not Applicable |
| 18. | Rebalance Period: | Not Applicable |
| 19. | Exchange: | Not Applicable |
| 20. | Related Exchange: | Not Applicable |
| 21. | Multiple Exchange: | Not Applicable |
| 22. | Reference Asset: | The Reference Asset in respect of the ETP Securities is the following: Not Applicable |
| 23. | Severe Disruption Event: | Not Applicable |
| 24. | Condition 20 (Interest Amounts): | Applicable |
| | (i) Interest Payment Dates: | As per the Conditions |
| 25. | Form of ETP Securities: | Registered Notes: Global Note registered in the name of a nominee for a common depositary for Euroclear and Clearstream, Luxembourg.<br><br>NGN Form: no |
| 26. | Portfolio Administrator: | Flexinvest Limited |
| 27. | Issuing and Paying Agent: | U.S. Bank Europe DAC |
| 28. | Registrar: | U.S. Bank Europe DAC |
| 29. | Portfolio Administration Agreement: | Flexinvest Portfolio Administration Agreement |
| 30. | Terms and Conditions which apply to this Series: | Terms and Conditions Version 10 |
| 31. | Authorised Participant | As per Issuer's website |
| 32. | Agency Agreement: | U.S. Bank Agency Agreement |
| 33. | Operating Procedures Agreement: | LS Operating Procedures Agreement |

The Issuer accepts the responsibility for the information contained in these Final Terms.

## PART B – OTHER INFORMATION

1. **Listing and admission to trading:**

Application has been made to the Financial Conduct Authority ("**FCA**") for the ETP Securities to which these Final Terms apply to be admitted to the Official List of the FCA. Application has been made to the London Stock Exchange for the ETP Securities to which these Final Terms apply to be admitted to trading on the Main Market of the London Stock Exchange.

Please note that admission to the UK Official List and to trading on the London Stock Exchange is not admission to trading under the Prospectus Regulation, but is admission to trading for the purposes of the PRM.

Please note that the admission to trading on the stock exchanges listed below is under the Prospectus Regulation:

Application has been made for the Series of ETP Securities to which these Final Terms apply to be admitted to listing and trading on Euronext Amsterdam, the regulated market operated by Euronext Amsterdam.

Application has been made to the Frankfurt Stock Exchange (Frankfurter Wertpapierbörse) for the Series of ETP Securities to which these Final Terms apply to be admitted to listing and trading on Deutsche Börse Xetra.

2. **Notification**

The Central Bank has provided the competent authorities of Italy, Germany, France, Spain, the Netherlands, Poland, Belgium, Sweden, Norway and Austria with a certificate of approval attesting that the Base Prospectus has been drawn up in accordance with the Prospectus Regulation. This should not be considered as an endorsement of the quality of the securities that are the subject of these Final Terms and investors should make their own assessment as to the suitability of investing in the securities.

3. **Interests of natural and legal persons involved in the issue**

So far as the Issuer is aware, no person involved in the offer of the ETP Securities has an interest material to the offer.

| | |
|---|---|
| Names and addresses of additional Paying Agent(s) (if any): | Not applicable |

4. **Distribution**

| | |
|---|---|
| Non-exempt Offer: | An offer of the ETP Securities may be made by the Authorised Offerors specified in Paragraph 8 of Part B below other than pursuant to Article 1 of the Prospectus Regulation in Ireland, Italy, Germany, France, Spain, the Netherlands, Poland, Belgium, Sweden, Norway and |

| | |
|---|---|
| | Austria ("EU Non-exempt Offer Jurisdictions") during the Offer Period. See further Paragraph 8 of Part B below. |
| Additional Selling Restrictions: | Not Applicable |

5. **Information about the past and the further performance of an Index and its volatility**

| | |
|---|---|
| Information about the past and further performance of the Index and its volatility can be obtained from: | Not Applicable |

6. **Information concerning the Issuer of the Reference Asset and the Reference Asset**

| | |
|---|---|
| Address of Issuer of the Reference Asset: | Not Applicable |
| Country of Incorporation of the Issuer of the Reference Asset: | Not Applicable |
| Nature of Business of the Issuer of the Reference Asset: | Not Applicable |
| Market on which the Reference Asset is admitted to trading: | Not Applicable |
| Description of the market in which the Reference Asset is traded: | Not Applicable |
| Date of establishment of market in which the Reference Asset is traded: | Not Applicable |
| How price information is published in respect of the market on which the Reference Asset is traded: | Not Applicable |
| An indication of daily trading volumes: | Not Applicable |
| Standing of the market on which the Reference Asset is traded and the market's regulatory authority: | Not Applicable |
| Frequency of publication of prices of the Reference Asset: | Not Applicable |
| Main accounts relating to the Reference Asset: | The Reference Asset will be held by the Margin Loan Provider in the Margin Account. |

7. **Operational Information**

| | |
|---|---|
| ISIN Code: | XS3299465412 |
| Common Code: | Not applicable |
| Names and addresses of additional Paying Agent(s) (if any): | Not applicable |

8. **Terms and Conditions of the Offer**

| | |
|---|---|
| Offer Price: | Issue Price |
| Time period, including any possible amendments, during which the offer will be open: | 12 months from the Base Prospectus Date. |
| Conditions to which the offer is subject: | Offers of the ETP Securities are conditional upon their issue and, as between the Authorised Offeror(s) and their customers, any further conditions as may be agreed between them. |
| Description of the application process: | The ETP Securities are being made available by the Issuer for subscription only to Authorised Participants who have submitted a valid subscription order to the Issuer. New issuances of ETP Securities will generally be settled on the second London Business Day following the date on which a valid subscription order is received by the Issuer, together with the applicable fee, provided that such order is received prior to 2.30 p.m. London time on such day. |
| Description of possibility to reduce subscriptions and manner for refunding excess amount paid by applicants: | Not Applicable |
| Details of the minimum and/or maximum amount of application: | Not Applicable |
| Details of the method and time limited for paying up and delivering the ETP Securities: | The ETP Securities will be issued on the Issue Date against payment to the Issuer of the net subscription moneys |
| Manner in and date on which results of the offer are to be made public: | The Issuer will sell the ETP Securities to the Authorised Participant on issue. The Authorised Participant will act as a market maker and may also offer the ETP Securities to the public in over-the-counter transactions during the Offer Period. The Authorised Participant may hold the ETP Securities on its inventory. The number of ETP Securities issued will not vary based on the results of an offer and as a result, there is no necessity to notify the public of the results of any offer. |
| Procedure for exercise of any right of pre-emption, negotiability of subscription rights and treatment of subscription rights not exercised: | Not Applicable |
| Whether tranche(s) have been reserved for certain countries: | Not Applicable |
| Process for notification to applicants of the amount allotted and the indication whether dealing may begin before notification is | Not Applicable |

| | |
|---|---|
| made: | |
| Amount of any expenses and taxes specifically charged to the subscriber or purchaser: | Not Applicable |
| Name(s) and address(es), to the extent known to the Issuer, of the placers in the various countries where the offer takes place. | None |
| Name and address of financial intermediary/ies authorised to use the Base Prospectus, as completed by these Final Terms (the "**Authorised Offerors**"): | Each Authorised Participant expressly named as an Authorised Offeror on the Issuer's website (www.leverageshares.com). |
| Prohibition of Sales to EEA Retail Investors: | Not applicable |
| 9. Intended to be held in a manner which would allow Eurosystem eligibility: | No. Whilst the designation is specified as "No" at the date of these Final Terms, should the Eurosystem eligibility criteria be amended in the future such that the Notes are capable of meeting them the Notes may then be deposited with one of the ICSDs as common safekeeper and registered in the name of a nominee of one of the ICSDs acting as common safekeeper. Note that this does not necessarily mean that the Notes will then be recognised as eligible collateral for Eurosystem monetary policy and intra day credit operations by the Eurosystem at any time during their life. Such recognition will depend upon the ECB being satisfied that Eurosystem eligibility criteria have been met. |

## ANNEX 1 – ISSUE SPECIFIC SUMMARY

### A Introduction and Warnings

This summary should be read as an introduction to the base prospectus of Leverage Shares plc as approved by the Central Bank of Ireland (the "**Base Prospectus**" and "the **Issuer**"). Any decision to invest in the ETP Securities (as defined below) should be based on consideration of the Base Prospectus as a whole by the investor. **AN INVESTOR MAY LOSE THE VALUE OF ITS ENTIRE INVESTMENT OR PART OF IT.** Where a claim relating to the information contained in the Base Prospectus is brought before a court, the plaintiff investor might, under the national legislation of the Member States, have to bear the costs of translating the Base Prospectus before the legal proceedings are initiated. Civil liability attaches only to those persons who have tabled the summary including any translation thereof, but only if the summary is misleading, inaccurate or inconsistent when read together with the other parts of the Base Prospectus or it does not provide, when read together with the other parts of the Base Prospectus, key information in order to aid investors when considering whether to invest in the ETP Securities.

| | |
|---|---|
| *Issuer:* | Leverage Shares Plc, 2nd Floor, Block 5, Irish Life Centre, Abbey Street Lower, Dublin 1, D01 P767, Ireland.<br>Website: https://leverageshares.com<br>Telephone: +353 1 2240300<br>LEI: 635400TLFJSNHVSOFH59 |
| *Competent Authority:* | Central Bank of Ireland, New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, Ireland<br>Website: https://centralbank.ie<br>Telephone: + 353 (0) 1 224 6000 |

*Date of approval of the Base Prospectus:* 11 June 2026.

***Issue Specific Summary:***

*Securities: Series: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP, ISIN: XS3299465412*

### B Key Information on the Issuer

*Who is the Issuer of the Securities?*

The Issuer is Leverage Shares PLC, a public limited company domiciled in Ireland and incorporated under the Companies Act 2014 of Ireland with registered number 597399. The Issuer operates under the laws of Ireland. The Issuer's LEI number is 635400TLFJSNHVSOFH59.

The Issuer's described principal activity is the issuance of and performance of its obligations under collateralised exchange traded securities (the "**ETP Securities**"). The Issuer has established a programme (the "**Programme**"), described in the Base Prospectus, under which series of ETP Securities (each a "**Series**") may be issued from time to time.

All the issued shares of the Issuer are directly or indirectly held by Monument Trustees Limited, with its registered office at 57 Herbert Lane, Dublin 2, Ireland and registered number 345558 (the "**Share Trustee**") under the terms of a declaration of trust dated 20 June 2017 pursuant to which the Share Trustee holds the benefit of the shares on trust for charitable purposes. The Issuer is neither directly nor indirectly owned or controlled by any other party to the Programme.

The Directors of the Issuer are Neil Fleming and Ciarán Connolly.

The auditors of the Issuer are Grant Thornton, 18 City Quay, Dublin 2, Ireland, who are chartered accountants qualified to practice in Ireland and members of the Institute of Chartered Accountants in Ireland.

***Issue Specific Summary:***

*The Issuer has appointed the following service providers in respect of the ETP Securities:*

- *Apex Corporate Trustees (UK) Limited will act as trustee (the "**Trustee**");*
- *Flexinvest Limited will act as portfolio administrator (the "**Portfolio Administrator**");*

- *Interactive Brokers LLC and/or Morgan Stanley & Co. LLC and/or Pershing LLC will act as margin loan provider (the "**Margin Loan Provider(s)**");*
- *Leverage Shares Management Company Limited will act as the arranger;*
- *U.S. Bank Europe DAC will act as issuing and paying agent;*
- *U.S. Bank Europe DAC will act as registrar;*
- *Calculation Agent Services LLC will act as determination agent;*
- *GWM Limited will act as broker dealer of record;*
- *The authorised participants are listed on the Issuer's website.*

*What is the key financial information regarding the Issuer?*

**Statement of Comprehensive income of Leverage Shares plc for the financial period**

| | 1-Jul-24<br><br>To<br>30-Jun-2025<br>USD - Audited | 1-Jul-23<br><br>To<br>30-Jun-2024<br>USD - Audited |
|---|---|---|
| Net profit/(loss) | - 53,223 | 4,935 |

**Statement of financial position of Leverage Shares plc for the financial period ended**

| | 30-Jun-2025<br>USD - Audited | 30-Jun-2024<br>USD - Audited |
|---|---|---|
| Total Assets | 3,586,373,432 | 2,046,580,088 |
| Total Liabilities | 3,586,439,659 | 2,046,593,092 |
| Financial Assets designated at fair value through profit or loss | 3,367,625,495 | 1,935,575,783 |
| Derivative financial assets | 0 | 0 |
| Financial liabilities designated at fair value through profit or loss | 1,368,044,139 | 790,712,170 |
| Derivative financial liabilities | 0 | 0 |

*What are the key risks that are specific to the Issuer?*

**The Issuer is a special purpose vehicle:** The Issuer is a special purpose vehicle with the sole business of issuing ETP Securities. The Issuer's only funds to make payments in respect of a Series of ETP Securities are the amounts received by the Issuer from the realisation of the Collateral Assets (as defined below). For each Series, the Issuer will create security over the Collateral Assets in respect of that Series for the benefit of, amongst others, the ETP Securityholders of that Series. In the event that the security created by the Issuer is enforced, and the proceeds of such enforcement are, after making payment to all senior ranking creditors, insufficient to pay all amounts due to such ETP Securityholders in full, the Issuer shall have no liability, obligation or debt for any shortfall in payment and none of the ETP Securityholders or the Trustee (or any other party acting on their behalf) may take any further action to recover such amounts.

**Claims of the Margin Loan Provider:** Investors should be aware that the agreements entered into between the Issuer and the Margin Loan Providers (the "**LS Margin Account Agreements**") do not contain limited recourse provisions with respect to the obligations of the Issuer.

There is a risk therefore that, in respect of a claim against the Issuer by a Margin Loan Provider in relation to an LS Margin Account Agreement, if following realisation in full of the Secured Property (whether by way of liquidation or enforcement) in respect of a Series of ETP Securities and application of available cash in accordance with the applicable orders of priority and the Trust Deed, a claim remains outstanding against the Issuer, such claim may be made against assets attributable to other outstanding Series of ETP Securities on a *pro rata* basis. GWM Limited, who may act as the broker dealer of record with respect to certain Series of ETP Securities (the "**Broker Dealer of Record**") however, has agreed to indemnify the Issuer against any loss, cost, claim, action, demand or expense which the Issuer may incur as a result of any such claims by the Margin Loan Provider.

## C Key Information on the Securities

*What are the main features of the Securities?*

Each Series of ETP Securities will either be linked to an index (the "I**ndex**") or will pursue an investment strategy which will describe the manner in which the proceeds of the issuance of the ETP Securities will be invested along with any leverage to be employed in respect of such investment strategy (the "**Investment Strategy**"). The Index or Investment Strategy will reference one or more assets (the "**Reference Assets**") which can consist of (i) equity securities, (ii) debt securities, (iii) fixed income securities, (iv) units in exchange traded funds; (v) mutual funds (items (i) to (v), ("**Physical Assets**") or (vi) futures contracts and (vii) options contracts.

Series of ETP Securities can offer leveraged long exposure ("**Leveraged Exposures**"), short inversed leveraged exposure ("**Short Exposures**") or +1x exposure ("**Normal Exposures**") to the Reference Assets. With respect to Series of ETP Securities offering Leveraged Exposures and Short Exposures, the degree of leverage or inversed leverage will be embedded in either (i) the Index or Investment Strategy; or (ii) directly in the ETP Securities. The degree of leverage which will apply for each Series of ETP Securities will be reflected in the applicable leverage factor (the "**Leverage Factor"**). Series of ETP Securities may also be issued which have the objective of generating income to fund periodic interest payments (the "**Income Series**"). The Investment Strategy of an Income Series may also provide for a Leveraged Exposure to the relevant Reference Assets, details of which will be included in the description of the Investment Strategy.

The collateral assets in respect of each Series of ETP Securities are:

- in the case of Leveraged Exposures and Normal Exposures where the Reference Assets are Physical Assets: the Reference Assets of the applicable Index or Investment Strategy for such Series of ETP Securities; Ancillary Assets (as defined below); and any cash;

- in the case of Short Exposures where the Reference Assets are Physical Assets: the mark to market value of securities loans; the Ancillary Assets; and any cash;

- in the case of ETP Securities where the Reference Assets are futures contracts: the mark to market value of the futures contracts; the Ancillary Assets; and any cash;

- in the case of Income Series where the Reference Assets are options contracts: the mark to market value of the options contracts; any underlying assets of the options contracts acquired by the Issuer to (i) cover its exposure under the options in accordance with the Investment Strategy or (ii) as a result of the options contracts being physically settled; Ancillary Assets; and any cash;

- in the case of Income Series where the Reference Assets are Physical Assets: the Reference Assets of the Investment Strategy for such Series of ETP Securities; Ancillary Assets; and any cash,

in each case as held in the margin account(s) established for that Series (the "**Margin Account**" and the "**Collateral Assets**").

Amounts standing to the credit of a Margin Account in respect of a Series of ETP Securities, to the extent not required for investment to replicate the performance of the relevant Index for that Series or for investment in accordance with the Investment Strategy for that Series, may at the direction of the Portfolio Administrator be maintained as cash balances in the Margin Account or invested in sovereign debt in the currency of denomination of the ETP Securities with an original maturity of less than one month which is rated at least A-1 by Standard & Poor's Ratings Services, and/or P-1 by Moody's Investors Service Ltd. and/or F1 by Fitch Ratings Limited (the "**Ancillary Assets**").

Where applicable, each Series of ETP Securities will reference the performance of the related Index or Investment Strategy over a daily, weekly, monthly period or such other period as set out in the Final Terms (the "**Rebalance Period**"). At the end of each Rebalance Period the Margin Account will be reconstituted in order to track the performance of the Index or pursue the Investment Strategy.

The redemption amount of the ETP Securities will be derived from the liquidation of the Collateral Assets, as purchased or sold in accordance with the Leverage Factor of such Series of ETP Securities.

In respect of each Income Series, the Issuer shall make payments of interest amounts in respect of the ETP Securities of that Series on the relevant interest payment date as set out in the Final Terms.

The ETP Securities are freely transferable.

Each Series of ETP Securities will only give rights to ETP Securityholders to participate in the proceeds of the liquidation of a *pro rata* portion, in respect of such ETP Securityholders, of the Collateral Assets held in the relevant Margin Account with respect to such Series, after the pro rata deduction of all costs and expenses incurred by the Issuer in connection with the liquidation of such Collateral Assets, the *pro rata* deduction of the Arranger Fee and any applicable margin interest, securities lending fees and brokerage fees ("**Funding and Brokerage Fees**") accrued thereon and in the case of Income Series, any pro rata adjustments to take account of any interest amounts to be paid with respect to the ETP Securities. Such liquidation will take place on the Final Redemption Date (as specified below) or only in limited circumstances before this date.

On specified valuation days, an "**ETP Security Value**" shall be calculated by the Determination Agent which shall reflect the value of the Collateral Assets in respect of a Series of ETP Securities as adjusted to take into account all applicable fees and expenses.

For each Series, the Issuer will create security over the Collateral Assets in respect of that Series for the benefit of, amongst others, the ETP Securityholders of that Series. Following the enforcement of the security granted by the Issuer in respect of each Series, the Trustee will apply the proceeds derived from the realisation of the Collateral Assets that are the subject of the security in the applicable order of priority under which amounts due to the ETP Securityholders will be subordinated to all costs, fees, expenses and all other amounts including (without limitation) the costs of enforcing and/or realising any security due to the Trustee itself and any receiver, in each case in relation to the ETP Securityholders.

If, in relation to a Series of ETP Securities, the net proceeds of the realisation of the security created in respect of such Series by the Issuer are insufficient to pay all amounts owed by the Issuer to the secured creditors (other than the Margin Loan Provider(s)) in respect of that Series, no other assets of the Issuer will be available to meet any shortfall and all outstanding claims of such secured creditors will be extinguished. No party (other than the Margin Loan Provider(s)) will be entitled to take any further steps against the Issuer to recover any further sum.

***Issue Specific Summary:***

*Investment objective: To pursue the LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy which seeks to generate monthly income by selling options on Super Micro Computer, Inc. and paying a return based on the cash held. The strategy may also trade options for hedging purposes.*

*Series: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP*

*ISIN: XS3299465412*

*Number of ETP Securities: 15000*

*The ETP Securities issued pursuant to these Final Terms are denominated in USD.*

*The final maturity date of the ETP Securities is 19 March 2076 (the "**Final Redemption Date**").*

*Each ETP Security has a Principal Amount of USD 10.00.*

*Where will the Securities be traded?*

***Issue specific summary:***

*Application has been made to the Financial Conduct Authority ("FCA") for the ETP Securities to which these Final Terms apply to be admitted to the Official List of the FCA. Application has been made to the London Stock Exchange for the ETP Securities to which these Final Terms apply to be admitted to trading on the Main Market of the London Stock Exchange.*

*Application has been made for the Series of ETP Securities to which these Final Terms apply to be admitted to listing and trading on Euronext Amsterdam, the regulated market operated by Euronext Amsterdam.*

*Application has been made to the Frankfurt Stock Exchange (Frankfurter Wertpapierbörse) for the Series of ETP Securities to which these Final Terms apply to be admitted to listing and trading on Deutsche Börse Xetra.*

*What are the key risks that are specific to the Securities?*

**AN INVESTMENT IN ETP SECURITIES INVOLVES A SIGNIFICANT DEGREE OF RISK.** The following are the key risk factors which should be carefully considered by prospective investors before deciding whether to invest in ETP Securities. Investors should consult their own financial, legal, accounting and tax advisors about the risks of an investment in ETP Securities.

Market price of the ETP Securities: The ETP Securities may have a long term and the Final Redemption Date could be up to 50 years from the original Issue Date of the Series.

The only means through which an investor will be able to realise value from an ETP Security prior to their Final Redemption Date will be to sell it at its then market price in a secondary market transaction.

Market-making by Authorised Participants: Investors are dependent on there being one or more Authorised Participants making a market in ETP Securities in order to provide investors with liquidity. Investors should be aware that no Authorised Participant is obliged to make a market for any Series of ETP Securities and in circumstances where an Authorised Participant acts a market maker with respect to any Series of ETP Securities, such Authorised Participant may discontinue making a market at any time. If there are no Authorised Participants, or the Authorised Participant(s) fail to effectively make a market in the ETP Securities of a Series, the investors may not be able to sell any such ETP Securities within a short time period, or at a price close to the ETP Security Value for that Series. If investors are unable to sell the ETP Securities they will be unable to realise their investment until the final redemption date.

***Issue Specific Summary***

*ETP Securities linked to an Investment Strategy: Each ETP Security will be linked to the performance of the Reference Assets referenced by such Investment Strategy. Investors have no ownership rights in any Reference Assets of an Investment Strategy. The amount payable on redemption of the ETP Securities will depend on the liquidation of the Collateral Assets in relation to that Series.*

*ETP Securities linked to Equity Securities: The risks of an ETP Security linked to equity securities may include, but are not limited to, the possibility of significant changes in the price(s) of the relevant equities. The value of the relevant equities may go down as well as up and the value of any relevant equities on any date may not reflect their performance in any prior period. There can be no assurance as to the future value of any equity security or of the continued existence of any equity, debt or its related company. Accordingly, before making an investment decision with respect to ETP Securities, prospective investors should carefully consider whether an investment, the return on which will depend on the performance of equity securities, is suitable for them.*

*Actively managed investment strategy: ETP Securityholders have no right to participate in the management of the Collateral Assets of a Series of ETP Securities. All decisions with respect to the investment of the proceeds of issuance of the ETP Securities will be made in accordance with the LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. No person should purchase any ETP Securities unless they are willing to entrust all aspects of management of the Collateral Assets to the Portfolio Administrator to invest in accordance with the LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. Poor performance of the LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy may negatively impact the value of the ETP Securities which may result in the ETP Securityholders receiving less, or substantially less than their initial investment.*

*ETP Securities linked to short positions in put options: selling put options exposes the ETP Securities to the risk that the price of the Underlying Asset of the put option falls below its Strike Price on the Exercise Date. The Issuer may enter the put options on a covered basis by setting aside sufficient cash to meet its obligations under the put options. However, the Issuer may not hold cash to cover its exposure under the put options, which may cause a loss or early unwind to the extent the put options are wholly or partly uncovered. Additionally, to the extent the put options are physically settled, the Issuer may from time to time be required to take delivery of the Underlying Assets. To the extent that it owns the Underlying Assets, the Issuer will be exposed to the risk of the price of the Underlying Assets decreasing which may result in a decrease of the ETP Security Value.*

**D Key Information on the Offer of Securities to the Public and/or the Admission to Trading on a Regulated Market**

*Under which conditions and timetable can I invest in this security?*

The ETP Securities are being made available by the Issuer for subscription only to Authorised Participants appointed by the Issuer in relation the Programme who have submitted a valid subscription order to the Issuer. New issuances of ETP Securities will generally be settled on the second London Business Day (a day (other than a Saturday or Sunday) on which commercial banks and foreign exchange markets settle payments in London) following the date on which a valid subscription order is received by the Issuer, together with the applicable fee, provided that such order is received prior to 2.30p.m. London time on such day.

In respect of each Series of ETP Securities, the fees payable by ETP Securityholders comprise the following components: (i) an Arranger fee which is charged at a rate of 0.55% per annum of the ETP Security Value held by an ETP Securityholder; (ii) the relevant Funding and Brokerage Fees which are subject to adjustment; (iii) taxes, fees and other amounts payable to the Irish Revenue Commissioners; (iv) amounts payable to the Margin Loan Provider and the Broker Dealer of Record; and (v) the costs and expenses incurred in connection with the liquidation of the Collateral Assets.

The Issuer will pass these costs on to investors, therefore reducing the value of their investment in the ETP Securities. No other costs will be charged to investors by the Issuer.

***Issue Specific Summary:***

An offer of the ETP Securities that is not within an exemption from the requirement to publish a prospectus under the Regulation (EU) 2017/1129 during the relevant offer period may be made in Ireland, Italy, Germany, France, Spain, the Netherlands, Poland, Belgium, Sweden, Norway and Austria.

*Why is this prospectus being produced?*

The reasons for the offer and use of proceeds are profit making and/or hedging.

***Issue Specific Summary:***

*The estimated net amount of the proceeds of issuance is USD 70688.72.*

The Issuer will use the proceeds of issuance to fund the related Margin Accounts as may be required to maintain positions in the Reference Assets in order to replicate (to the degree practicable) the return of the Index or to pursue the Investment Strategy referenced by the Series taking into account the applicable Leverage Factor. Amounts standing to the credit of the Margin Account may also, at the discretion of the Portfolio Administrator, be maintained as cash balances in the Margin Account or invested in Ancillary Assets.

The offer of ETP Securities is not subject to an underwriting agreement on a firm commitment basis.

*Material Conflicts of Interest*

The Authorised Participants and/or their respective affiliates may be active traders in certain markets. These trading activities may present a conflict between the holders of the ETP Securities and the interests the Authorised Participants and their respective affiliates may have in their proprietary accounts, in facilitating transactions, including options and other derivatives transactions, for their customers and in accounts under their management. These trading activities, if they influence the value of an Index or Investment Strategy to which a Series of ETP Securities is linked, could be adverse to the interests of the ETP Securityholders. The Authorised Participants and their respective affiliates may also issue or underwrite additional securities or trade other products the return on which is linked to the value of an Index or Investment Strategy linked to a Series of ETP Securities or other similar strategies. An increased level of investment in these products may negatively affect the level of an Index or Investment Strategy to which a Series of ETP Securities is linked and therefore the amount payable in respect of such Series of ETP Securities on their stated maturity date or any prior redemption date, as applicable, and the market value of such ETP Securities.

GWM Limited (who may act as the Broker Dealer of Record and/or Authorised Participant in respect of a Series of ETP Securities), Flexinvest Limited (who may act as Portfolio Administrator), FlexAdvisor Limited (who may act as Portfolio Administrator) and the Determination Agent are under the common ownership of Jose Gonzalez who is also a director and the ultimate majority shareholder of the Arranger. Where such entities are acting, they will have only the duties and responsibilities expressly agreed to by them in the relevant capacity and will not, by virtue of being related to an entity acting in any other capacity, be deemed to have other duties or responsibilities or be deemed to hold a standard of care other than as expressly provided with respect to each such capacity.

## ANEXO 1 – RESUMEN ESPECÍFICO DE LA EMISIÓN

### A. Introducción y Advertencias

Este resumen debe leerse como una introducción al folleto base de Leverage Shares plc aprobado por la Banco Central de Irlanda (el "**Folleto Base**" y "el **Emisor**"). Cualquier decisión de invertir en los Títulos de Productos Negociados en Bolsa (ETP, por sus siglas en inglés) (como se define a continuación) debe basarse en la consideración del Folleto Base en su conjunto por parte del inversor. **UN INVERSOR PUEDE PERDER EL VALOR DE TODA SU INVERSIÓN O PARTE DE ELLA.** Cuando una reclamación relacionada con la información contenida en el Prospecto Base se presente ante un tribunal, el inversor demandante podría, de conformidad con la legislación nacional de los Estados miembros, tener que asumir los costes de traducir el Folleto Base antes de que se inicien los procedimientos legales. La responsabilidad civil aplica solo a aquellas personas que han presentado el resumen, incluida cualquier traducción del mismo, pero solo si el resumen es engañoso, impreciso o inconsistente en su lectura conjunta con las demás partes del Folleto Base o no proporcione, en dicha lectura conjunta, información clave con el fin de ayudar a los inversores a considerar invertir en los Títulos ETP.

| | |
|---|---|
| *Emisor:* | Leverage Shares Plc, 2nd Floor, Block 5, Irish Life Centre, Abbey Street Lower, Dublin 1, D01 P767, Irlanda.<br><br>Sitio Web: https://leverageshares.com<br><br>Teléfono: +353 1 2240300<br><br>LEI: 635400TLFJSNHVSOFH59 |
| *Autoridad Competente:* | Central Bank of Ireland, New Wapping Street, North Wall Quay, Dublín 1, Irlanda<br><br>Sitio Web: https://centralbank.ie<br><br>Teléfono: + 353 (0) 1 224 6000 |

*Fecha de aprobación del Prospecto Base:* 11/06/2026. Suplementos: 07/07/2026.

***Resumen Específico de la Emisión:***

*Títulos: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP, ISIN: XS3299465412*

### B. Información Fundamental sobre el Emisor

*¿Quién es el Emisor de los Títulos?*

El Emisor es Leverage Shares PLC, una sociedad anónima domiciliada en Irlanda y constituida bajo la Ley de Sociedades de 2014 de Irlanda con el número de registro 597399. El Emisor opera bajo las leyes de Irlanda. El número LEI del Emisor es el 635400TLFJSNHVSOFH59.

La actividad principal descrita por el Emisor es la emisión de Títulos garantizados negociados en bolsa (los "**Títulos ETP**") y el cumplimiento de las obligaciones derivadas de los mismos. El Emisor ha establecido un programa (el "**Programa**"), en el Folleto Base, bajo el cual se pueden emitir series de Títulos ETP (cada una, "**Series**").

Todas las acciones emitidas del Emisor son propiedad directa o indirecta de Monument Trustees Limited, con domicilio social en 57 Herbert Lane, Dublín 2, Irlanday con número registrado 345558 (el "**Fideicomisario de Acciones**") según los términos de una declaración de fideicomiso de fecha 20 de Junio, 2017 en virtud de la cual el Fideicomisario de Acciones mantiene el beneficio de las acciones en fideicomiso con fines benéficos. El Emisor no es propiedad ni está controlado directa o indirectamente por ninguna otra entidad descrita en el Programa.

Los Directores del Emisor son Neil Fleming y Ciarán Connolly.

Los auditores del Emisor son, Grant Thornton, 18 City Quay, Dublín 2, Irlanda, que son contables públicos calificados para ejercer en Irlanda y miembros del "Institute of Chartered Accountants" de Irlanda.

***Resumen Específico de la Emisión:***

*El Emisor ha designado a los siguientes proveedores de servicios con respecto a los Títulos ETP:*

- *Apex Corporate Trustees (Reino Unido) Limited actuará como fideicomisario (el "**Fideicomisario**");*

- Flexinvest Limited *actuará como administrador de la cartera (el "**Administrador de la Cartera**");*
- *Interactive Brokers LLC y/o Morgan Stanley & Co. LLC y/o Pershing LLC actuarán como proveedor/es de préstamos de Margen (el "**Proveedor (es) de Préstamos de Margen**");*
- *Leverage Shares Management Company Limited actuará como el Estructurador;*
- *U.S. Bank Europe DAC actuará como agente emisor y pagador;*
- *U.S. Bank Europe DAC actuará como registrador;*
- *Calculation Agent Services LLC actuará como agente de determinación;*
- *GWM Limited actuará como el agente bursátil de registro; y*
- *Los participantes autorizados están listados en el sitio web del Emisor.*

*¿Cuál es la información financiera fundamental con respecto al Emisor?*

**Estado de resultados integrales de Leverage Shares plc para el período financiero**

| | 1-Jul-24<br>al<br>30-Jun-2025<br>USD - Auditado | 1-Jul-23<br>al<br>30-Jun-2024<br>USD - Auditado |
|---|---|---|
| Beneficio neto/(pérdidas) | - 53,223 | 4,935 |

**Estado de situación financiera de Leverage Shares plc para el período financiero finalizado**

| | 30-Jun-2025<br>USD - Auditado | 30-Jun-2024<br>USD - Auditado |
|---|---|---|
| Activos Totales | 3,586,373,432 | 2,046,580,088 |
| Total Pasivos | 3,586,439,659 | 2,046,593,092 |
| Activos financieros designados a valor razonable con cambios en resultados | 3,367,625,495 | 1,935,575,783 |
| Activos financieros derivados | 0 | 0 |
| Pasivos financieros designados a valor razonable con cambios en resultados | 1,368,044,139 | 790,712,170 |
| Pasivos financieros derivados | 0 | 0 |

*¿Cuáles son los riesgos fundamentales que son específicos del Emisor?*

**El Emisor es una entidad con cometido especial:** El Emisor es una entidad con cometido especial con el único negocio de emitir Títulos ETP. Los únicos fondos del Emisor para realizar pagos con respecto a una Serie de Títulos ETP son las cantidades recibidas por el Emisor de la enajenación de los Activos en Garantía (tal y como se define más adelante). Para cada Serie, el Emisor titulizará los Activos en Garantía con respecto a esa Serie en beneficio de, entre otros, los Titulares de Títulos ETP de esa Serie.

En el caso de que se ejecuten los derechos derivados de dicha titulización creados por el Emisor, y los ingresos de dicha ejecución sean, después de hacer el pago a todos los acreedores con prioridad superior, insuficientes para pagar en su totalidad todas las cantidades debidas a dichos titulares de Títulos ETP, el Emisor no tendrá ninguna responsabilidad, obligación o deuda por cualquier déficit en el pago y ninguno de los Titulares de Títulos de ETP o el Fiduciario (o cualquier otra parte que actúe en su nombre) puede tomar medidas adicionales para recuperar dichas cantidades.

**Reclamaciones del Proveedor de Préstamos de Margen:** Los inversores deben tener en cuenta que los acuerdos celebrados entre el Emisor y el Proveedor de Préstamos **de Margen**, (los "**Acuerdos de Cuenta de Préstamos de Margen LS**") no contiene disposiciones que limiten la responsabilidad del Emisor con respecto a sus obligaciones. Por lo tanto, existe el riesgo de que, con respecto a una reclamación contra el Emisor por parte de un Proveedor de Préstamos de Margen en relación con un Acuerdo de Cuenta de Margen LS, si después de la realización total de la Propiedad Asegurada (ya sea mediante liquidación o ejecución) con respecto a una Serie de Títulos ETP y la aplicación del efectivo disponible de acuerdo con el orden de prioridad aplicable y la Escritura Fiduciaria, una reclamación sigue pendiente contra el Emisor, dicha reclamación puede hacerse contra activos atribuibles a otras

Series de Títulos ETP en emisión en forma proporcional. Sin embargo, GWM Limited, quien puede actuar como agente bursátil registrado en relación con ciertas Series de Títulos ETP (el **"Agente bursátil registrado"**), acordó indemnizar al Emisor por cualquier pérdida, coste, reclamación, acción, demanda o gasto en el que el Emisor pueda incurrir como resultado de dichas reclamaciones por parte del Proveedor de Préstamos de Margen.

**C Información Fundamental sobre los Títulos**

*¿Cuáles son las principales características de los Títulos?*

Cada Serie de Títulos ETP estará vinculada a un índice (el "**Índice**") o seguirá una estrategia de inversión que describirá la forma en que se invertirán los ingresos de la emisión de los Títulos ETP junto con cualquier apalancamiento que se empleará con respecto a dicha estrategia de inversión (la "**Estrategia de Inversión**"). El Índice o la Estrategia de Inversión harán referencia a uno o más activos (los "**Activos de Referencia**") los cuales pueden consistir en (i) títulos participativos, (ii) títulos de deuda, (iii) títulos de renta fija, (iv) participaciones en fondos cotizados ETFs; (v) fondos de inversión (conceptos (i) al (v), ("**Activos Físicos**") o (vi) contratos de futuros y (vii) contratos de opciones.

Una Serie de Títulos ETP puede ofrecer una exposición apalancada "larga" ("**Exposiciones Apalancadas**"), una exposición apalancada inversa corta ("**Exposiciones Cortas**") o una exposición +1x ("**Exposiciones Normales**") a los Activos de Referencia. Con respecto a una Serie de Títulos ETP que ofrecen las Exposiciones Apalancadas y Exposiciones Cortas, el grado de apalancamiento o apalancamiento inverso se integrará o bien en (i) el Índice o Estrategia de Inversión; o (ii) directamente en los Títulos ETP. El grado de apalancamiento que se aplicará a cada Serie de Títulos ETP se reflejará en el factor de apalancamiento aplicable (el "**Factor de Apalancamiento"**).

También podrán emitirse Series de Valores ETP que tengan como objetivo generar ingresos para financiar pagos periódicos de intereses (la "**Serie de Ingresos**"). La Estrategia de Inversión de una Serie de Ingresos también puede prever una Exposición Apalancada a los Activos de Referencia correspondientes, cuyos detalles se incluirán en la descripción de la Estrategia de Inversión.

Los activos de garantía correspondientes a cada Serie de Valores ETP son:

- en el caso de Exposiciones Apalancadas y Exposiciones Normales donde los Activos de Referencia son Activos Físicos: los Activos de Referencia del Índice o Estrategia de Inversión aplicable para dicha Serie de Títulos ETP; Activos Auxiliares (tal y como se define más adelante); y cualquier efectivo;
- en el caso de Exposiciones Cortas donde los Activos de Referencia son Activos Físicos: el valor ajustado al mercado de los préstamos de Títulos; los Activos Auxiliares; y cualquier efectivo;
- en el caso de Títulos ETP donde los Activos de Referencia son contratos de futuros: el valor ajustado al mercado de los contratos de futuros; los Activos Auxiliares; y cualquier efectivo;
- en el caso de Series de Ingresos donde los Activos de Referencia son contratos de opciones: el valor de mercado de los contratos de opciones; cualquier activo subyacente de los contratos de opciones adquiridos por el Emisor para (i) cubrir su exposición bajo las opciones de acuerdo con la Estrategia de Inversión o (ii) como resultado de la liquidación física de los contratos de opciones; Activos Auxiliares; y cualquier dinero en efectivo;
- en el caso de Series de Ingresos donde los Activos de Referencia son Activos Físicos: los Activos de Referencia de la Estrategia de Inversión para dicha Serie de Valores ETP; Activos Auxiliares; y cualquier efectivo;

en cada caso como se mantiene en la(s) cuenta(s) de préstamo establecida(s) para esa Serie (la "**Cuenta de Préstamo**" y los "**Activos de Garantía**").

Las cantidades en efectivo en una Cuenta de Préstamo con respecto a una serie de Títulos ETP, en la medida que no sean necesarias para que la inversión reproduzca el rendimiento del Índice relevante para esa Serie o para la inversión de acuerdo con la Estrategia de Inversión de esa Serie podrán, bajo la dirección del Administrador de la Cartera, mantenerse como saldos de efectivo en la Cuenta de Préstamo o invertirse en deuda soberana en la moneda de denominación de los Títulos ETP con un vencimiento original de menos de un mes que tenga una calificación estándar de al menos A-1 por los Servicios de Calificaciones de Standard & Poor's, y/o P-1 por Moody's Investors Service Ltd. y/o F1 por Fitch Ratings Limited (los "**Activos Auxiliares**").

Cuando corresponda, cada Serie de Títulos ETP hará referencia al rendimiento del Índice o a la Estrategia de Inversión relacionada durante un período diario, semanal, mensual o cualquier otro período establecido en los Términos Finales (el "**Período de Reequilibrio**"). Al final de cada Período de Reequilibrio, la Cuenta de Préstamo se reconstituirá con el fin de realizar un seguimiento del rendimiento del Índice o seguir la Estrategia de Inversión.

El importe de la amortización de los Títulos ETP se derivará de la liquidación de los Activos de Garantía, tal como se hayan comprado o vendido de acuerdo con el Factor de Apalancamiento de dicha Serie de Títulos ETP.

**Con respecto a cada Serie de Ingresos, el Emisor realizará pagos de los importes de intereses con respecto a los Valores ETP de esa Serie en la fecha de pago de intereses correspondiente, tal como se establece en las Condiciones Finales.**

Los Títulos ETP son libremente transferibles.

Cada Serie de Títulos ETP solo otorgará derechos a los titulares de Títulos ETP para participar en las ganancias de la liquidación de una parte proporcional, con respecto a dichos titulares de Títulos ETP, de los Activos de Garantía mantenidos en la Cuenta de Préstamo pertinente con respecto a dichas Series, después de la deducción prorrateada de todos los costes y gastos incurridos por el Emisor en relación con la liquidación de dichos Activos de Garantía, la deducción prorrateada de la Comisión del Estructurador y cualquier interés de Préstamo Apalancado, tarifas de préstamo de Títulos y comisiones de corretaje ("**Comisiones de Financiación y Corretaje**") acumuladas al respecto y, en el caso de la Serie de Ingresos, cualquier ajuste prorrateado para tener en cuenta los importes de intereses a pagar con respecto a los Valores ETP. Dicha liquidación tendrá lugar en la Fecha de Amortización Final (tal y como se define más adelante) o solo en circunstancias limitadas antes de esta fecha.

En los días de valoración específicos, el Agente de Determinación calculará un "**Valor de los Títulos ETP**" que reflejará el valor de los Activos de Garantía con respecto a cada Serie de Títulos ETP ajustados para tener en cuenta todas las comisiones y gastos aplicables.

Para cada Serie, el Emisor titulizará los Activos de Garantía con respecto a esa Serie en beneficio de, entre otros, los titulares de Títulos ETP de esa Serie. Tras la ejecución de los derechos derivados de dicha titulización otorgados por el Emisor con respecto a cada Serie, el Fiduciario destinará los ingresos derivados de la realización de los Activos de Garantía sujetos a tales derechos en el orden de prioridad aplicable, con arreglo al cual las cantidades adeudadas a los titulares de Títulos ETP estarán subordinadas al pago de todos los costes, comisiones, gastos y demás cantidades, incluidos (sin limitación) los costes de hacer cumplir y/o ejecutar cualquier título debido al Fideicomisario y a cualquier administrador concursal, en cada caso en relación con los titulares de Títulos ETP.

Si, en relación con una Serie de Títulos ETP, los ingresos netos de la ejecución del título creado con respecto a dicha Serie por el Emisor son insuficientes para pagar todas las cantidades adeudadas por el Emisor a los acreedores garantizados (distintos del Proveedor(es) de Préstamos Apalancados) con respecto de esa Serie, ningún otro activo del Emisor estará disponible para cubrir cualquier déficit y todas las reclamaciones pendientes de dichos acreedores garantizados se extinguirán. Ninguna parte (que no sea el Proveedor(es) de Préstamos Apalancados) tendrá derecho a tomar medidas adicionales contra el Emisor para recuperar cualquier suma adicional.

***Resumen Específico de la Emisión:***

*Objetivo de inversión: Perseguir la LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy, que busca generar ingresos mensuales mediante la venta de opciones sobre Super Micro Computer, Inc. y el pago de una rentabilidad basada en el efectivo mantenido. La estrategia también puede negociar opciones con fines de cobertura.*

*Series: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP.*

*ISIN: XS3299465412*

*Número de Títulos ETP: 15000*

*Los Títulos ETP emitidos de conformidad con estos Términos Finales están denominados en Dólares estadounidenses.*

*La fecha final de vencimiento de los Títulos ETP es 19/03/2076 (La "Fecha de Amortización Final").Cada Título ETP tiene un Principal de USD 10.00.*

*¿Dónde se negociarán los Títulos?*

***Resumen Específico de la Emisión:***

Se ha presentado una solicitud a la Autoridad de Conducta Financiera (la "FCA", por sus siglas en inglés) para la Serie de Títulos ETP a los que aplican estos Términos Finales para ser admitidos en la Lista Oficial de la FCA. Se ha presentado una solicitud a la Bolsa de Valores de Londres para la Serie de Títulos ETP a los que aplican estos Términos Finales para ser admitidos a negociación en el Mercado Principal de la Bolsa de Valores de Londres.

Se ha presentado una solicitud para la Serie de Títulos ETP a los que aplican estos Términos Finales para ser admitidos a negociación y cotización en Euronext Ámsterdam, el mercado regulado operado por Euronext Ámsterdam.

Se ha presentado una solicitud a la Bolsa de Valores de Frankfurt (Frankfurter Wertpapierbörse) para que la Serie de Valores ETP a los que se aplican estas Condiciones Finales sean admitidas a cotización y negociación en Deutsche Börse Xetra.

*¿Cuáles son los riesgos fundamentales que son específicos a los Títulos?*

**UNA INVERSIÓN EN TÍTULOS ETP IMPLICA UN GRADO DE RIESGO ELEVADO.** Los siguientes son los factores de riesgo fundamentales que los posibles inversores deben considerar cuidadosamente antes de decidir invertir en Títulos ETP. Los inversores deben consultar a sus propios asesores financieros, legales, contables y fiscales sobre los riesgos de una inversión en Títulos ETP.

Precio de mercado de los Títulos ETP: Los Títulos ETP pueden tener un largo plazo y la Fecha de Amortización Final puede ser de hasta 50 años a partir de la Fecha de Emisión original de la Serie. El único medio a través del cual un inversor podrá obtener un valor de reembolso de un Título ETP antes de su Fecha de Amortización Final será venderlo a su precio de mercado en una transacción de mercado secundario.

Creación de mercado por Participantes Autorizados: Los inversores dependen de que haya uno o más Participantes Autorizados que realicen un mercado de Títulos ETP para proporcionar liquidez a los inversores. Los inversores deben tener en cuenta que ningún Participante Autorizado está obligado a crear un mercado para una Serie de Títulos ETP y en circunstancias en las que un Participante Autorizado actúa como creador de mercado con respecto a cualquier Serie de Títulos ETP, dicho Participante Autorizado puede dejar de crear un mercado en cualquier momento. Si no hay Participantes Autorizados, o los Participantes Autorizados no logran efectivamente crear un mercado en los Títulos ETP de una Serie, es posible que los inversores no puedan vender dichos Títulos ETP en un corto período de tiempo o a un precio cercano al valor del Título ETP para esa Serie. Si los inversores no pueden vender los Títulos ETP, no podrán realizar su inversión hasta la fecha de amortización final.

***Resumen Específico de la Emisión***

*Títulos ETP vinculados a una Estrategia de Inversión: Cada Título ETP estará vinculado al rendimiento de los Activos de Referencia a los que hace referencia dicha Estrategia de Inversión. Los inversores no tienen derechos de propiedad sobre ningún Activo de Referencia de una Estrategia de Inversión. El importe a pagar en la amortización de los Títulos ETP dependerá de la liquidación de los Activos de Garantía en relación con esa Serie.*

*Títulos ETP vinculados a Acciones: Los riesgos de Títulos ETP vinculados a acciones pueden incluir, entre otros, la posibilidad de variaciones significativas del precio de dichas acciones. El valor de las acciones de referencia puede incrementarse o depreciarse en cualquier momento, sin que dicho valor refleje su rentabilidad durante períodos anteriores. No hay garantía alguna en referencia al valor futuro de ninguna acción o la existencia continuada de la entidad emisora, sus títulos participativos o deuda. Así pues, antes de tomar una decisión de inversión sobre los Títulos ETP, los inversores debe evaluar si una inversión cuya rentabilidad dependerá de la evolución de acciones, es adecuada para ellos.*

*Estrategia de Inversión Activa: Los inversores en los Títulos ETP no tienen derecho a participar en la gestión de los Activos de Referencia. Toda decisión de inversión sobre los montantes resultantes de la emisión de Títulos ETP se realizará conforme a la estrategia LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. No se debe invertir en los Títulos ETP si no se está dispuesto a confiar la gestión de los Activos de Referencia al Administrador de la Cartera conforme a la estrategia LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. Una mala rentabilidad de la estrategia LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy puede ocasionar un impacto negativo sobre el valor de los Títulos ETPs y hacer que los inversores reciban mucho menos de lo que invirtieron inicialmente.*

*Títulos ETP vinculados a posiciones cortas sobre opciones de venta: la venta de opciones de venta ('put options') expone a los Títulos ETP al riesgo de que el precio del subyacente de la opción de venta caiga por debajo de su precio de ejercicio en la fecha de ejercicio. El Emisor puede adoptar 'posiciones cubiertas', esto es, mantener en efectivo cantidades suficientes para cubrir las pérdidas derivadas de las opciones. Sin embargo, es posible que el Emisor no tenga la cantidad suficiente para cubrir su exposición a los riesgos de las opciones, lo que podría causar una pérdida o liquidación anticipada de las posiciones cortas sobre las opciones. Además, en la medida que las opciones se ejecuten mediante la transferencia de los activos subyacentes, el Emisor corre el riesgo de que caigan sus precios, lo que a su vez causaría una disminución del Valor de los Títulos ETP.*

**D Información fundamental sobre la Oferta de Títulos al Público y/o la Admisión a Cotización en un Mercado Regulado**

*¿En qué condiciones y horarios puedo invertir en ese Título?*

El Emisor pone a disposición los Títulos ETP para la suscripción solo a los Participantes Autorizados designados por el Emisor en relación con el Programa que hayan remitido una orden de suscripción válida al Emisor. Las nuevas emisiones de Títulos ETP generalmente se liquidarán el segundo día hábil de Londres (un día (que no sea sábado o domingo) en el que los bancos comerciales y los mercados de divisas liquiden los pagos en Londres) después de la fecha en que el Emisor reciba una orden de suscripción válida, junto con la tarifa aplicable, siempre que dicha orden se reciba antes de las 2:30 p.m. Hora de Londres en ese día.

Con respecto a cada Serie de Títulos ETP, las tarifas pagaderas por los titulares de Títulos ETP comprenden los siguientes componentes: (i) una tarifa del Estructurador del 0.55% anual del Valor del Título ETP en poder de un titular del Título ETP; (ii) las Comisiones de Financiación y Corretaje correspondientes que están sujetas a ajustes; (iii) impuestos, comisiones y otros montos pagaderos a los Comisionados de Ingresos Irlandeses; (iv) importes pagaderos al Proveedor de Préstamos Apalancados y a la Casa Oficial de Bolsa; y (v) los costes y gastos incurridos en relación con la liquidación de los Activos de Garantía.

El Emisor repercutirá estos costes a los inversores, reduciendo así el valor de su inversión en los Títulos ETP. El Emisor no cobrará otros costes a los inversores.

***Resumen Específico de la Emisión:***

Una oferta de los Valores ETP que no se encuentre dentro de una exención del requisito de publicar un prospecto conforme al Reglamento (UE) 2017/1129 durante el período de oferta aplicable puede efectuarse en Irlanda, Italia, Alemania, Francia, España, los Países Bajos, Polonia, Bélgica, Suecia, Noruega y Austria.

*¿Por qué se ha preparado este folleto?*

Los motivos de la oferta y el uso de los ingresos son la obtención de beneficios y/o cobertura.

***Resumen Específico de la Emisión:***

*La cantidad neta estimada del producto de la emisión es 70688.72 Dólares estadounidenses.*

El Emisor utilizará el producto de la emisión para financiar las Cuentas de Préstamo relacionadas, según sea necesario, para mantener posiciones en los Activos de Referencia con el fin de replicar (en la medida de lo posible) el rendimiento del Índice o seguir la estrategia de inversión a la que hace referencia la Serie teniendo en cuenta el Factor de Apalancamiento aplicable. Los montos correspondientes al crédito de la Cuenta de Préstamo también pueden, a discreción del Administrador de la Cartera, mantenerse como saldos de efectivo en la Cuenta de Préstamo o invertirse en Activos Auxiliares.

La oferta de Títulos ETP no está sujeta a un acuerdo de suscripción sobre una base de compromiso firme.

*Conflictos de Interés Relevantes*

Los Participantes Autorizados y/o sus afiliados respectivos pueden ser comerciantes activos en ciertos mercados. Estas actividades comerciales pueden presentar un conflicto entre los titulares de los Títulos ETP y los intereses que los Participantes Autorizados y sus respectivas filiales puedan tener en sus cuentas de propiedad, para facilitar las transacciones, incluidas las opciones y otras transacciones de derivados, para sus clientes y en las cuentas bajo su administración. Estas actividades comerciales, si influyen en el valor de un Índice o Estrategia de Inversión a la que está vinculada una Serie de Títulos ETP, podrían ser adversas a los intereses de los titulares de Títulos ETP. Los Participantes Autorizados y sus respectivas filiales también pueden emitir o suscribir títulos adicionales o comercializar otros productos cuyo rendimiento está vinculado al valor de un Índice o Estrategia de Inversión vinculada a una Serie de Títulos ETP u otras estrategias similares. Un mayor nivel de inversión en estos productos puede afectar negativamente el nivel de un Índice o Estrategia de Inversión a la que está vinculada una Serie de Títulos ETP y, por lo tanto, al monto pagadero con respecto a dicha Serie de Títulos ETP en su fecha de vencimiento establecida o en cualquier fecha de reembolso anterior, según corresponda, y el valor de mercado de dichos Títulos ETP.

GWM Limited (que podrá actuar como Broker Dealer of Record y/o Participante Autorizado con respecto a una Serie de Valores ETP), Flexinvest Limited (que podrá actuar como Administrador de Cartera), FlexAdvisor Limited (que podrá actuar como Administrador de Cartera) y el Agente de Determinación están bajo la propiedad común de Jose Gonzalez, quien también es director y el accionista mayoritario último del Estructurador. Cuando dichas entidades actúen, solo tendrán los deberes y responsabilidades expresamente acordados por ellas en la capacidad

correspondiente y no, por el mero hecho de estar relacionadas con una entidad que actúe en cualquier otra capacidad, se considerará que tienen otros deberes o responsabilidades ni que deben observar un estándar de diligencia distinto del expresamente previsto para cada una de dichas capacidades.

**ALLEGATO 1- NOTA DI SINTESI SPECIFICA DELL'EMISSIONE**

## A Introduzione ed avvertenze

Questo sommario deve essere letto come un'introduzione al prospetto di base di Leverage Shares plc come approvato dalla Banca centrale d'Irlanda (il **"Prospetto di Base"** e l'"**Emittente"**). Qualsiasi decisione riguardo ad un investimento in titoli ETP (come definito in seguito) dovrebbe basarsi sulla considerazione da parte dell'investitore del Prospetto di Base nella sua interezza. **UN INVESTITORE POTREBBE PERDERE IL VALORE DELL'INTERO INVESTIMENTO O PARTE DI ESSO.** Quando un reclamo relativo alle informazioni contenute nel Prospetto di Base viene portato dinanzi ad un tribunale, l'investitore querelante deve, sotto legislazione degli Stati Membri, occuparsi dei costi per la traduzione del Prospetto di Base, prima che i procedimenti giudiziari abbiano inizio. La responsabilità civile si applica solo a coloro che abbiano presentato il documento di sintesi, inclusa qualsiasi traduzione dello stesso, ma solo nel caso in cui il documento di sintesi fosse fuorviante, impreciso o contraddittorio quando letto insieme alle altre parti del Prospetto di Base, o nel caso in cui non fornisca, quando letto insieme alle altre parti del Prospetto di Base, le informazioni chiave per aiutare gli investitori nella scelta di investire o meno nei titoli ETP.

| | |
|---|---|
| *Emittente:* | Leverage Shares Plc, 2nd Floor, Block 5, Irish Life Centre, Abbey Street Lower, Dublin 1, D01 P767, Ireland.<br><br>Website: https://leverageshares.com<br><br>Telephone: +353 1 2240300<br>LEI: 635400TLFJSNHVSOFH59 |
| *Autorità competente:* | Central Bank of Ireland, New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, Ireland<br><br>Sito Web: https://centralbank.ie<br><br>Telefono: + 353 (0) 1 224 6000 |

*Data di approvazione del prospetto di base:* 11/06/2026. Supplemento: 07/07/2026

***Sintesi specifica dell'emissione:***

*Titolo: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP, ISIN: XS3299465412*

## B Informazioni chiave sull'emittente

*Chi è l'emittente dei titoli?*

L'emittente è Leverage Shares PLC, una società per azioni domiciliata in Irlanda e costituita ai sensi della Legge sulle Società del 2014 con numero di registrazione 597399. L'emittente opera in base alle leggi Irlandesi. Il numero LEI dell'emittente è 635400TLFJSNHVSOFH59.

L'attività principale descritta dall'emittente è l'emissione e la prestazione delle proprie obbligazioni nell'ambito di titoli quotati in borsa assistiti da garanzie reali (i "**Titoli ETP"**). L'emittente ha stabilito un programma (il "**Programma"**), nel Prospetto di Base, in base al quale, di volta in volta, possono essere emesse serie di titoli ETP (ognuno una **"Serie"**).

Tutte le azioni emesse dall'emittente sono direttamente o indirettamente detenute da Monument Trustees Limited, il cui ufficio è registrato al 57 Herbert Lane, Dublino 2, Irlanda e con numero di registrazione 345558 (il **"Fiduciario"**) ai sensi di una dichiarazione di fiducia datata 20 giugno 2017, ai sensi della quale il Trustee detiene il beneficio delle azioni in trust per scopi caritatevoli.

L'emittente non è né direttamente né indirettamente appartenente o controllato da alcuna delle parti del Programma.

I Direttori dell'Emittente sono Neil Fleming e Ciarán Connolly.

I revisori dell'Emittente sono Grant Thornton, 18 City Quay, Dublino 2, Irlanda, i quali sono dottori commercialisti abilitati all'esercizio della professione in Irlanda e membri dell'Institute of Chartered Accountants in Irlanda.

**Sintesi Specifica dell'emissione:**

*L'emittente ha nominato i seguenti fornitori di servizi con riferimento ai titoli ETP:*

- *Apex Corporate Trustees (UK) Limited agirà in qualità di fiduciario (il **"Fiduciario"**);*
- Flexinvest Limited *agirà in qualità di amministratore competente (l'**"Amministratore Competente"**);*
- *Interactive Brokers LLC e/o Morgan Stanley & Co. LLC e/o Pershing LLC agiranno in qualità di prestatori (i "**Margin Loan Provider (s)**");*
- *Leverage Shares Management Company Limited agirà in qualità di organizzatore;*
- *U.S. Bank Europe DAC agirà in qualità di agente di emissioni e pagamenti;*
- *U.S. Bank Europe DAC agirà in qualità di agente decisionale;*
- *Calculation Agent Services LLC agirà in qualità di agente determination;*
- *GWM Limited agirà in qualità di intermediario finanziario; et*
- *I partecipanti autorizzati sono elencati sul sito web dell'Emittente.*

*Quali sono le informazioni finanziarie chiave riguardanti l'emittente?*

**Prospetto del conto economico di Leverage Shares plc per l'esercizio finanziario**

| | 1-Jul-24<br><br>To<br>30-Jun-2025<br>USD - Sottoposto a revisione | 1-Jul-23<br><br>To<br>30-Jun-2024<br>USD - Sottoposto a revisione |
|---|---|---|
| Profitto netto/(perdita) | - 53,223 | 4,935 |

**Prospetto del rendiconto finanziario di Leverage Shares plc a fine esercizio finanziario**

| | 30-Jun-2025<br>USD - Audited | 30-Jun-2024<br>USD - Audited |
|---|---|---|
| Attività Totali | 3,586,373,432 | 2,046,580,088 |
| Passività Totali | 3,586,439,659 | 2,046,593,092 |
| Attività finanziarie valutate a fair value | 3,367,625,495 | 1,935,575,783 |
| Attività finanziarie derivate | 0 | 0 |
| Passività finanziarie valutate a fair value | 1,368,044,139 | 790,712,170 |
| Passività finanziarie derivate | 0 | 0 |

*Quali sono i rischi maggiori a cui l'emittente è esposto?*

**L'emittente è uno special purpose vehicle:** L'emittente è uno special purpose vehicle con il compito esclusivo di emettere titoli ETP. Gli unici fondi dell'Emittente per effettuare pagamenti in relazione a una Serie di Titoli ETP sono gli importi ricevuti dall'Emittente dalla realizzazione delle Attività collaterali (come definito di seguito). Per ciascuna Serie, l'emittente creerà garanzie sulle Attività collaterali relative alla Serie, a beneficio, fra gli altri, dei detentori degli ETP di quella Serie. Nel caso in cui la garanzia creata dall'emittente venga applicata ed i proventi, dopo il pagamento di tutti i creditori senior, siano insufficienti a pagare tutti gli importi dovuti ai detentori dei titoli ETP, l'Emittente non ha alcuna responsabilità, obbligo o debito per eventuali carenze nei pagamenti e nessuno dei possessori dei titoli ETP o del Trustee (o di qualunque altra parte che agisca per loro conto) può intraprendere qualsiasi ulteriore azione per recuperare tali importi.

**Reclami del prestatore di margini:** Gli investitori devono essere consapevoli che gli accordi stipulati tra l'emittente ed il prestatore di margini ("**LS Margin Account Agreement"**), non contiene disposizioni di ricorso limitate per quanto concerne le obbligazioni dell'Emittente. Esiste pertanto il rischio che, con riferimento ad una querela nei confronti dell'emittente da parte del prestatore di margini, in relazione al LS Margin Account Agreement, se in seguito alla realizzazione integrale della garanzia (sia a titolo di liquidazione che di applicazione) in relazione ad una serie di titoli ETP e all'applicazione della liquidità disponibile in conformità con gli ordini di priorità applicabili e all'Atto Fiduciario, un reclamo rimanesse in essere nei confronti dell'Emittente, tale reclamo può essere presentato nei confronti delle attività attribuibili ad altre Serie di Titoli ETP in circolazione, su base proporzionale. GWM Limited, che può agire come negoziatore di credito relativamente ad alcune serie di ETPs (il "**Negoziatore di credito**"), tuttavia, ha accettato di risarcire l'emittente contro qualsiasi perdita, costo, azione, pretesa o spesa che potrebbero verificarsi a seguito di tali reclami da parte del Margin Loan Provider.

**C Informazioni chiave sui titoli**

*Quali sono le caratteristiche principali dei titoli?*

Ciascuna serie di titoli ETP sarà collegata ad un indice **("L'Index")** o seguirà una strategia di investimento che descriverà il modo in cui i proventi dell'emissione dei titoli di ETP saranno investiti insieme ad ogni leva finanziaria, da impiegare con riferimento a tale strategia di investimento (la **"Investment strategy"**). L'indice o la Strategia di Investimento faranno riferimento ad uno o più attività (il **"Reference Assets"**) che possono consistere in (i) titoli azionari, (ii) titoli di debito, (iii) titoli a reddito fisso, (iv) quote di fondi indicizzati quotati; (v) fondi comuni di investimento (voci da (i) a (v), (**"Physical Assets"**) o (vi) contratti a termine e (vii) contratti di opzione.

Le Serie di titoli ETP possono offrire esposizioni lunghe con effetto leva (**"Leveraged Exposures"**), esposizioni corte (**"Short Exposures"**) o esposizioni +1x (**"Normal Exposures"**) alle attività sottostanti. Per quanto riguarda le serie di titoli ETP che offrono esposizioni con effetto leva ed esposizioni corte, il grado di leva finanziaria o leva finanziaria inversa sarà incorporato (i) nell'indice o nella strategia di investimento; o (ii) direttamente nei titoli di ETP. Il grado di leva finanziaria che si applicherà a ciascuna serie di titoli ETP si rifletterà nell'effetto leva applicabile (il **"Leverage Factor"**). Possono inoltre essere emesse serie di titoli ETP che hanno l'obiettivo di generare reddito per finanziare i pagamenti periodici di interessi (le "**Income Series**"). La Strategia di investimento di un Income Series può anche prevedere un'esposizione con leva finanziaria alle relative attività di riferimento, i cui dettagli saranno inclusi nella descrizione della Strategia di investimento.

I beni di garanzia relativi a ciascuna Serie di Titoli ETP sono:

- Nel caso delle leve finanziarie e delle esposizioni normali in cui gli asset di riferimento sono beni materiali: gli attivi di riferimento dell'indice applicabile o della strategia di investimento per una tale strategia di titoli ETP; beni ausiliari (come definito sotto); e denaro liquido;
- Nel caso delle esposizioni corte dove gli asset di riferimento sono contratti a termine: il valore mark to market dei contratti a termine; i beni ausiliari; e il denaro liquido, in ogni caso detenute nei conti a margine stabiliti per quella serie (il **"Margin Account"** e **"Collateral Assets"**).
- Nel caso di Income Series in cui le Attività di Riferimento sono contratti di opzione: il valore mark to market dei contratti di opzione; qualsiasi attività sottostante dei contratti di opzione acquisiti dall'Emittente per (i) coprire la propria esposizione nell'ambito delle opzioni in conformità con la Strategia di investimento o (ii) a seguito del regolamento fisico dei contratti di opzione; Beni accessori; ed eventuali contanti;
- Nel caso di Income Series in cui le Attività di Riferimento sono Attività Fisiche: le Attività di Riferimento della Strategia di Investimento per tale Serie di Titoli ETP; Titoli accessori; ed eventuali contanti;

Gli importi accreditati presso un conto a margine relativamente ad una serie di titoli ETP, nella misura in cui non siano necessari per replicare la performance del relativo indice o per gli investimenti in conformità con la strategia perseguita da quella serie, possono, sotto la direzione del Portfolio Administrator, essere mantenuti come saldo di cassa nel conto a margine o essere investiti in obbligazioni governative con la medesima valuta di denominazione dei titoli ETP, con scadenza inferiore ad un mese, valutate almeno A-1 da Standard & Poor's Ratings Services, e/o P-1 da Moody's Investors Service Ltd. e/o F1 da Fitch Ratings Limited (gli "**Ancillary Assets"**).

Ove applicabile, ciascuna serie di titoli ETP farà riferimento alla performance del relativo indice o Strategia di Investimento su un periodo giornaliero, settimanale, mensile o qualsiasi altro periodo di tempo come indicato nelle condizioni definitive (il **"Rebalance Period"**). Al termine del Rebalance Period il conto a margine sarà ricostituito al

fine di seguire la performance dell'indice o perseguire la strategia di investimento.

L'importo di rimborso dei titoli ETP deriverà dalla liquidazione dei Collateral Assets, acquistati o venduti in conformità dell'effetto leva di quella determinata serie di titoli ETP.

In relazione a ciascuna Income Series, l'Emittente effettuerà pagamenti di importi di interessi rispetto ai Titoli ETP di quella Serie alla relativa data di pagamento degli interessi come indicato nelle Condizioni Definitive.

I titoli ETP sono trasferibili gratuitamente.

Ciascuna serie di titoli ETP conferirà ai detentori di titoli ETP il diritto di partecipare ai proventi della liquidazione su base proporzionale, relativamente a tali titoli ETP, dei Collateral Assets detenuti nel conto a margine corrispondente a tale serie, dopo la deduzione proporzionale di tutti i costi e le spese sostenute dall'emittente in relazione alla liquidazione dei Collateral Assets, la deduzione proporzionale della Arranger Fee e di eventuali interessi sui margini applicabili, le commissioni di prestito titoli e le commissioni di intermediazione (**"Funding and Brokerage Fees"**) maturati su di essi e nel caso delle Income Series, eventuali aggiustamenti pro rata per tenere conto di eventuali importi di interessi da pagare in relazione agli ETP Securities. Tale liquidazione avverrà alla data di rimborso finale (come specificato di seguito) o, solo in circostanze limitate, prima di questa data.

In specifici giorni di valutazione, un **"ETP Security Value"** deve essere calcolato da un Determination Agent, tenendo conto del valore dei Collateral Assets in relazione ad una serie di titoli ETP, rettificato per tenere in considerazione tutte le commissioni e le spese applicabili.

Per ogni serie, l'emittente creerà garanzie sui Collateral Assets in relazione a tale serie a beneficio, fra gli altri, di tutti i detentori di titoli ETP di tale serie. A seguito all'esecuzione della garanzia concessa dall'emittente in relazione a ciascuna serie, il fiduciario utilizzerà i proventi derivanti dalla realizzazione dei Collateral Assets, che sono oggetto della garanzia, nell'ordine di priorità applicabile, in base al quale gli importi dovuti ai detentori di titoli ETP saranno subordinati ad ogni costo, commissione, spesa, insieme a tutte le altre somme, inclusi (senza alcuna limitazione) i costi dell'esecuzione e/o realizzazione delle garanzie dovute al fiduciario stesso e qualsiasi destinatario, in ogni caso in relazione ai detentori di titoli ETP.

Se, in relazione ad una serie di titoli ETP, i proventi netti della realizzazione della garanzia creata in merito a ciascuna serie dall'emittente siano insufficienti a pagare tutte le somme dovute dall'emittente ai creditori garantiti (diversi dal Margin Loan Provider(s)) in merito a quella serie, nessun'altra attività dell'emittente sarà disponibile per far fronte ad eventuali carenze, e tutti i crediti pendenti di tali creditori garantiti saranno estinti. Nessuna parte (deversa dal Margin Loan Provider(s)) avrà diritto ad adottare ulteriori provvedimenti nei confronti dell'emittente per recuperare ulteriori somme.

***Sintesi specifica dell'emissione:***

*Obiettivo dell'investimento: Perseguire la LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy, che mira a generare reddito mensile vendendo opzioni su Super Micro Computer, Inc. e pagando un rendimento basato sulla liquidità detenuta. La strategia può anche negoziare opzioni a scopo di copertura.*

*Serie: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP.*

*ISIN: XS3299465412*

*Numero di titoli ETP: 15000*

*I titoli ETP emessi ai sensi di queste condizioni definitive sono denominati in Dollari americani.*

*La data di scadenza finale dei titoli ETP è 19/03/2076 (la "Data finale di rimborso").Ogni titolo ETP ha un importo nominale di USD 10.00.*

*Dove saranno scambiati I titoli?*

***Sintesi specifica dell'emissione:***

*La richiesta è stata inoltrata al Financial Conduct Authority (la "FCA") per la serie di titoli ETP a cui si applicano le presenti condizioni definitive, per essere ammessi all' Elenco Ufficiale della FCA. Una domanda è stata inoltrata alla Borsa di Londra per la serie di titoli ETP a cui si applicano queste condizioni definitive, per l'ammissione alla negoziazione sul Mercato principale della Borsa di Londra.*
*La domanda è stata inoltrata per la serie di titoli ETP a cui fanno riferimento queste condizioni definitive per essere ammessi alla quotazione e negoziazione dell'Euronext Amsterdam, il mercato regolamentato da Euronext*

*Amsterdam.*
*È stata presentata una domanda alla Borsa di Francoforte (Frankfurter Wertpapierbörse) per l'ammissione alla quotazione e alla negoziazione su Deutsche Börse Xetra della serie di Titoli ETP a cui si applicano questi Termini Finali.*

*Quali sono I rischi principali specifici dei titoli?*

**UN INVESTIMENTO NEI TITOLI ETP COMPORTA UN GRADO SIGNIFICATIVO DI RISCHIO.** Di seguito sono riportati i principali fattori di rischio che devono essere presi in considerazione dai potenziali investitori prima di decidere se investire nei titoli ETP. Gli investitori dovrebbero consultare i propri consulenti finanziari, legali, contabili e fiscali riguardo i rischi di un investimento nei titoli ETP.

Prezzo di mercato dei titoli ETP: I titoli ETP potrebbero avere una durata a lungo termine e la Data di rimborso finale potrebbe essere fino a 50 anni dalla data di emissione originale della serie. L'unico mezzo attraverso il quale un investitore sarà in grado di realizzare il valore da un titolo ETP prima della data di rimborso finale sarà quello di venderlo al suo prezzo di mercato tramite un'operazione nel mercato secondario.

Market-making dei Partecipanti Autorizzati: Gli investitori dipendono dalla presenza di uno o più partecipanti autorizzati a creare un mercato nei titoli ETP per fornire liquidità agli investitori. Gli investitori devono essere consapevoli del fatto che nessun Partecipante Autorizzato è obbligato a creare un mercato per una serie di titoli ETP e, nella situazione in cui un Partecipante Autorizzato agisca in qualità di market maker rispetto a qualsiasi serie di titoli ETP, tale partecipante autorizzato può interrompere l'attività in ogni momento. Se non vi sono partecipanti autorizzati o i partecipanti autorizzati non riescono a creare effettivamente un mercato di titoli ETP, gli investitori potrebbero non essere in grado di vendere tali titoli ETP in un breve periodo di tempo o ad un prezzo vicino al valore di quella serie di titoli ETP. Se gli investitori non saranno in grado di vendere i titoli ETP non riusciranno a realizzare il loro investimento fino alla data di rimborso finale.

**Sommario Specifico dell'Emissione**

*Titoli ETP legati ad una strategia di investimento: Ciascun titolo ETP sarà collegato al rendimento degli asset sottostanti tale strategia di investimento. Gli investitori non hanno alcun diritto di proprietà sugli asset di riferimento di una strategia di investimento. La somma pagabile come rimborso dei titoli ETP dipenderà dalla liquidazione dei Collateral Assets in relazione a tale serie.*
*Titoli ETP collegati a Titoli azionari: i rischi di un titolo ETP collegato a titoli azionari possono includere, ma non sono limitati alla possibilità di variazioni significative nel prezzo o nei prezzi delle azioni pertinenti. Il valore delle azioni pertinenti può diminuire o aumentare e il valore di qualsiasi azione pertinente in qualsiasi data potrebbe non riflettere la loro performance in qualsiasi periodo precedente. Non vi può essere alcuna garanzia in merito al valore futuro di alcun titolo azionario o alla continua esistenza di qualsiasi capitale, debito o società ad esso collegata. Di conseguenza, prima di prendere una decisione di investimento in relazione ai Titoli ETP, i potenziali investitori dovrebbero valutare attentamente se un investimento, il cui rendimento dipenderà dalla performance dei titoli azionari, è adatto a loro.*

*Strategia di investimento a gestione attiva: i titolari di titoli ETP non possono partecipare alla gestione delle garanzie di una serie di titoli ETP. Tutte le decisioni relative all'investimento dei proventi dell'emissione di titoli ETP saranno prese in conformità con la strategia di LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. Nessuno dovrebbe acquistare titoli ETP a meno che non sia disposto ad affidare tutti gli aspetti della gestione delle garanzie all'amministratore del portafoglio al fine di investire in conformità con la strategia di LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. Una scarsa performance della strategia di LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy può influire negativamente sul valore dei titoli ETP, il che può comportare che i titolari di ETP ricevano meno o significativamente meno del loro investimento iniziale.*

*Titoli ETP collegati a posizioni corte in opzioni put: la vendita di opzioni put espone i titoli ETP al rischio che il prezzo dell'attività sottostante dell'opzione put scenda al di sotto del suo prezzo di esercizio alla data di esercizio. L'emittente può stipulare le opzioni put su base coperta accantonando denaro sufficiente per soddisfare i propri obblighi ai sensi delle opzioni put. Tuttavia, l'emittente non può detenere denaro per coprire la propria esposizione ai sensi delle opzioni put, il che potrebbe causare una perdita o una risoluzione anticipata nella misura in cui le opzioni put siano totalmente o parzialmente scoperte. Inoltre, nella misura in cui le opzioni put sono regolate fisicamente, l'emittente potrebbe di volta in volta essere tenuto a prendere in consegna le attività sottostanti. Inoltre, nella misura in cui possiede le attività sottostanti, l'emittente sarà esposto al rischio di diminuzione del prezzo delle attività sottostanti, il che potrebbe comportare una diminuzione del valore del titolo ETP*

## D Informazioni chiave sull'Offerta di titoli al Pubblico e/o l'Ammissione alla Negoziazione su un Mercato Regolamentato

*Secondo quali condizioni e orari posso investire in questo titolo?*

I titoli ETP sono resi disponibili dall'emittente per la sottoscrizione solo ai Partecipanti Autorizzati, incaricati dall'emittente in relazione al Programma, i quali abbiano presentato un valido ordine di sottoscrizione all'emittente. Le nuove emissioni di titoli ETP saranno generalmente regolate il secondo giorno lavorativo, secondo il calendario di Londra (un giorno differente da sabato o domenica, in cui le banche commerciali ed il mercato dei cambi regolano i pagamenti a Londra), successivo alla data in cui un ordine di sottoscrizione valido è ricevuto dall'emittente, unitamente alla commissione applicabile, a condizione che tale ordine sia ricevuto prima delle 14,30, ora di Londra.

In relazione a ciascuna serie di titoli ETP, le commissioni applicabili ai detentori di titoli comprendono le seguenti componenti: (i) una commissione di arrangiamento a cui è applicato un tasso annuale dello 0.55% del valore del titolo ETP detenuto; (ii) le commissioni di finanziamento ed intermediazione soggette a rettifica; (iii) tasse, commissioni ed altri importi dovuti alle Autorità Tributarie Irlandesi; (iv) importi dovuti al Prestatore di margini ed a Broker Dealer of Record; e (v) i costi e le spese sostenuti in relazione alla liquidazione dei Collateral Assets.

L'emittente trasferirà questi costi agli investitori, riducendo pertanto il valore del loro investimento nei titoli ETP. Nessun altro costo sarà addebitato agli investitori dall'emittente.

***Sommario Specifico dell'Emissione:***

*Un'offerta dei Titoli ETP che non rientra in un'esenzione dal requisito di pubblicare un prospetto ai sensi del Regolamento (UE) 2017/1129 durante il relativo periodo di offerta può essere effettuata in Irlanda, Italia, Germania, Francia, Spagna, Paesi Bassi, Polonia, Belgio, Svezia, Norvegia e Austria.*

Perché viene prodotto questo Prospetto?

Le ragioni dell'offerta e dell'uso degli incassi sono il lucro e/o la copertura del rischio.

**Sintesi specifica della Emissione:**

*L'importo netto stimato dei proventi dell'emissione è 70688.72 Dollari americani.*

L'emittente utilizzerà i proventi dell'emissione per finanziare i conti a margine relativi se ciò sarà necessario per mantenere le posizioni negli asset di riferimento al fine di replicare (per quanto possibile) il rendimento dell'indice o per perseguire la strategia di investimento a cui fa riferimento la serie, tenendo conto dell'effetto leva applicabile. Gli importi accreditati nel conto a margine potrebbero essere mantenuti inoltre, a discrezione dell'amministratore del portafoglio, come saldi di cassa nel conto a margine o essere investite in attività accessorie.

L'offerta di titoli ETP non è soggetta ad un accordo di sottoscrizione sulla base di un impegno irrevocabile.

*Conflitti di interesse*

I partecipanti autorizzati e/o le rispettive affiliate possono essere operatori attivi in determinati mercati. Queste attività di trading possono presentare un conflitto fra i detentori di titoli ETP e gli interessi che i partecipanti autorizzati e le loro rispettive affiliate possono avere nei loro conti proprietari, nell'agevolare le transazioni, includendo le opzioni ed altre operazioni su strumenti finanziari derivati, per i propri clienti e nei conti da loro amministrati. Queste attività di negoziazione, qualora influenzassero il valore di un indice o della strategia di investimento a cui una serie di titoli ETP è collegata, possono essere avverse agli interessi dei possessori di titoli ETP. I partecipanti autorizzati e le rispettive affiliate possono inoltre emettere o sottoscrivere ulteriori garanzie o scambiare altri prodotti il cui rendimento è collegato al valore di un indice o di una strategia di investimento collegati ad una serie di titoli ETP o altre strategie simili.

Un aumento del livello di investimento in questi prodotti può influenzare negativamente il valore di un indice o di una strategia di investimento cui una serie di titoli ETP è collegata e, quindi, l'importo da pagare con rispetto a tale serie di titoli ETP, allo loro data di scadenza o a qualsiasi precedente data di rimborso, ove applicabile, ed il valore di mercato di tali titoli ETP.

GWM Limited (che può agire quale Broker Dealer of Record e/o Partecipante Autorizzato in relazione a una Serie di Titoli ETP), Flexinvest Limited (che può agire quale Amministratore di Portafoglio), FlexAdvisor Limited (che può agire quale Amministratore di Portafoglio) e l'Agente di Determinazione sono sotto la proprietà comune di Jose Gonzalez, il quale è anche amministratore e azionista di maggioranza finale dell'Arranger. Quando tali entità agiscono, avranno esclusivamente i doveri e le responsabilità espressamente concordati nella relativa funzione e non saranno, per il solo fatto di essere collegate a un'entità che agisce in altra funzione, ritenute avere altri doveri o responsabilità né soggette a uno standard di diligenza diverso da quanto espressamente previsto per ciascuna di tali

funzioni.

## ANHANG 1 – THEMENSEPZIFISCHE ZUSAMMENFASSUNG

A Einleitungen und Warnhinweise

Diese Zusammenfassung sollte als Einführung in den Basisprospekt von Leverage Shares plc wie vom Zentralbank von Irland genehmigt (der „**Basisprospekt**" und „der **Aussteller**") gelesen werden. Jede Entscheidung in die ETP-Wertpapiere zu investieren (wie unten definiert) sollte auf der Berücksichtigung des Basisprospektes als Ganzes durch den Anleger beruhen. **EIN ANLEGER KANN DEN WERT SEINER GESAMTEN ANLAGE ODER EINES TEILS DAVON VERLIEREN.** Wird ein Anspruch in Bezug auf die im Basisprospekt enthaltenen Informationen vor einem Gericht geltend gemacht, so könnte der klagende Anleger nach den nationalen Rechtsvorschriften der Mitgliedstaaten die Kosten für die Übersetzung des Basisprospekts vor Einleitung des Gerichtsverfahrens tragen müssen. Die zivilrechtliche Haftung gilt nur für die Personen, die die Zusammenfassung einschließlich einer Übersetzung davon eingereicht haben, aber nur dann, wenn die Zusammenfassung irreführend, ungenau oder widersprüchlich ist, wenn sie zusammen mit den anderen Teilen des Basisprospekts gelesen wird, oder wenn sie, wenn sie zusammen mit den anderen Teilen des Basisprospekts gelesen wird, keine wesentlichen Informationen enthält, um Anlegern bei der Entscheidung über eine Investition in die ETP-Wertpapiere zu helfen.

| | |
|---|---|
| Aussteller*:* | Leverage Shares Plc, 2nd Floor, Block 5, Irish Life Centre, Abbey Street Lower, Dublin 1, D01 P767, Ireland.<br><br>Webseite: https://leverageshares.com<br><br>Telefon: +353 1 2240300<br>LEI: 635400TLFJSNHVSOFH59 |
| *Zuständige Behörde:* | Central Bank of Ireland, New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, Ireland<br><br>Webseite: https://centralbank.ie<br><br>Telefon: + 353 (0) 1 224 6000 |

*Genehmigungsdatum des* Basisprospekts: 11/06/2026. Ergänzung: 07/07/2026

***Ausstellungsspezifische Zusammenfassung:***

*Wertpapiere: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP, ISIN: XS3299465412*

**B Wichtige Informationen über den Aussteller**

*Wer ist der Aussteller der Wertpapiere?*

Der Aussteller ist Leverage Shares PLC, eine Aktiengesellschaft mit Sitz in Irland, die gemäß dem irischen Unternehmensgesetz 2014 unter der Registernummer 597399 gegründet wurde. Der Aussteller ist nach irischem Recht tätig. Die LEI-Nummer des Ausstellers lautet 635400TLFJSNHVSOFH59.

Die beschriebene Haupttätigkeit des Ausstellers ist die Ausstellung und Erfüllung seiner Verpflichtungen aus besicherten, börsengehandelten Wertpapieren (die „**ETP-Wertpapiere**"). Der Aussteller hat im Basisprospekt ein Programm (das „**Programm**") aufgestellt, unter dem von Zeit zu Zeit Serien von ETP-Wertpapieren (jeweils eine „**Serie**") ausgegeben werden können.

Alle ausgegebenen Aktien des Ausstellers werden direkt oder indirekt von Monument Trustees Limited mit Sitz in 57 Herbert Lane, Dublin 2, Irland, und der Registernummer 345558 (der „Aktientreuhänder") gemäß einer Treuhanderklärung vom 20. Juni 2017 gehalten, wonach der Aktientreuhänder die Aktien treuhänderisch für wohltätige Zwecke hält. Der Aussteller ist weder direkt noch indirekt im Besitz oder unter der Kontrolle einer anderen Partei des Programms.

Die Direktoren des Ausstellers sind Neil Fleming und Ciarán Connolly.

Die Rechnungsprüfer des Ausstellers sind Grant Thornton, Beaux Lane House, Mercer Street Lower,18 City Quay, Dublin 2, Irland, die als in Irland zugelassene Wirtschaftsprüfer und Mitglieder des Institute of Chartered Accountants in Irland tätig sind.

***Ausstellungsspezifische Zusammenfassung:***

*Der Aussteller hat die folgenden Dienstleister für die ETP-Wertpapiere ernannt:*

- *Apex Corporate Trustees (UK) Limited wird als Treuhänder (der „**Treuhänder**") fungieren;*
- Flexinvest Limited *wird als Portfolioverwalter (der „**Portfolioverwalter**") fungieren;*
- *Interactive Brokers LLC und/ oder Morgan Stanley & Co. LLC und/oder Pershing LLC werden als Margen - Kreditgeber (der '**Margen - Kreditgeber**') fungieren;*
- *Die Leverage Shares Management Company Limited wird als Arrangeur fungieren;*
- *U.S. Bank Europe DAC wird als Ausgabe- und Zahlstelle fungieren;*
- *U.S. Bank Europe DAC wird als Registrierungsstelle fungieren;*
- *Calculation Agent Services LLC wird als Ermittlungsstelle fungieren;*
- *GWM Limited fungiert als aktenkundiger Broker; und*
- *Die autorisierten Teilnehmer sind auf der Website des Emittenten aufgeführt.*

*Was sind die wichtigsten Finanzinformationen über den Aussteller?*

**Gesamtergebnisrechnung der Leverage Shares plc für die Geschäftsperiode**

| | 1-Jul-24<br><br>To<br>30-Jun-2025<br>USD -- Revidiert | 1-Jul-23<br><br>To<br>30-Jun-2024<br>USD - Revidiert |
|---|---|---|
| Reingewinn /(Verlust) | - 53,223 | 4,935 |

**Bilanz der Leverage Shares plc für die abgeschlossene Geschäftsperiode**

| | 30-Jun-2025<br>USD - Revidiert | 30-Jun-2024<br>USD - Revidiert |
|---|---|---|
| Gesamtvermögen | 3,586,373,432 | 2,046,580,088 |
| Gesamte Passiva | 3,586,439,659 | 2,046,593,092 |
| Finanzielle Vermögenswerte, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert eingestuft sind | 3,367,625,495 | 1,935,575,783 |
| Derivative finanzielle Vermögenswerte | 0 | 0 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert eingestuft sind | 1,368,044,139 | 790,712,170 |
| Derivative finanzielle Verbindlichkeiten | 0 | 0 |

*Welches sind die Hauptrisiken, die für den Aussteller spezifisch sind?*

**Der Aussteller ist eine Zweckgesellschaft**: Der Aussteller ist eine Zweckgesellschaft, die ausschließlich die Ausgabe von ETP-Wertpapieren betreibt. Die einzigen Mittel des Ausstellers, um Zahlungen in Bezug auf eine Serie von ETP-Wertpapieren zu leisten, sind die Beträge, die der Aussteller aus der Verwertung der Sicherungsgegenstände (wie unten definiert) erhält. Für jede Serie wird der Aussteller eine Sicherheit für die Beleihungsobjekte dieser Serie unter anderem zugunsten der Inhaber von ETP-Wertpapieren dieser Serie schaffen. Falls die von dem Aussteller geschaffene Sicherheit verwertet wird und der Erlös dieser Verwertung nach Zahlung an alle vorrangigen Gläubiger nicht ausreicht, um alle an diese ETP-Sicherheitsinhaber fälligen Beträge vollständig zu bezahlen, hat der Aussteller keine Haftung, Verpflichtung oder Schuld für einen Zahlungsausfall, und keiner der ETP-Sicherheitsinhaber oder der Treuhänder (oder eine andere in ihrem Namen handelnde Partei) darf weitere Maßnahmen zur Einziehung dieser Beträge ergreifen.

**Ansprüche des Anbieters von Margen-Krediten**: Die Anleger sollten sich darüber im Klaren sein, dass die zwischen dem Aussteller und dem Margen-Kreditgeber abgeschlossene Kundenvereinbarung (die „**Vereinbarung über das LS-Margen-Konto**") keine beschränkten Rückgriffrechte in Bezug auf die Verpflichtungen des Ausstellers vorsieht. Es besteht daher das Risiko, dass in Bezug auf eine Forderung des Margen-Kreditsgebers gegen den Aussteller in Bezug auf die Vereinbarung über das LS Margen-Konto, wenn nach der vollständigen Verwertung des gesicherten Eigentums (sei es im Wege der Liquidation oder der Vollstreckung) in Bezug auf eine Serie von ETP-Wertpapieren und der Verwendung verfügbarer Barmittel gemäß den anwendbaren Rangordnungen und der Treuhandurkunde eine Forderung gegen den Aussteller aussteht, eine solche Forderung gegen Vermögenswerte, die anderen ausstehenden Serien von ETP-Wertpapieren zuzuordnen sind, anteilig geltend gemacht werden kann. GWM Limited, die als **aktenkundiger Broker** bezüglich gewisser Serien an ETP-Wertpapieren in Erschienung treten kann (der **aktenkundige Broker**), hat sich jedoch bereit erklärt, den Aussteller gegen jegliche Verluste, Kosten, Ansprüche, Klagen, Forderungen oder Ausgaben, die dem Aussteller aufgrund solcher Ansprüche des Margen-Kreditgebers entstehen können, zu entschädigen.

## C Wichtige Informationen über die Wertpapiere

*Was sind die Hauptmerkmale der Wertpapiere?*

Jede Serie von ETP-Wertpapieren wird entweder an einen Index (der „**Index**") gebunden sein oder eine Anlagestrategie verfolgen, die die Art und Weise beschreibt, in der die Erlöse aus der Emission der ETP-Wertpapiere zusammen mit einer eventuellen Hebelwirkung in Bezug auf diese Anlagestrategie investiert werden (die „**Anlagestrategie**"). Der Index oder die Anlagestrategie bezieht sich auf ein oder mehrere Vermögenswerte (die „**Referenzvermögenswerte**"), die aus (i) Aktien, (ii) Schuldverschreibungen, (iii) festverzinslichen Wertpapieren, (iv) Anteilen an börsengehandelten Fonds; (v) Investmentfonds (Punkte (i) bis (v), („**physische Vermögenswerte**") oder (vi) Terminkontrakten bestehen können.

Der Index oder die Anlagestrategie bezieht sich auf einen oder mehrere Vermögenswerte (die "Referenzwerte"), die aus (i) Aktienwerten, (ii) Schuldtiteln, (iii) festverzinslichen Wertpapieren, (iv) Anteilen an börsengehandelten Fonds, (v) Investmentfonds (Punkte (i) bis (v), ("Sachwerte") oder (vi) Terminkontrakten und (vii) Optionskontrakten bestehen können.

Eine Reihe von ETP-Wertpapieren kann ein gehebeltes Long-Exposure („**Leveraged Exposures**"), ein kurzes inverses Leveraged-Exposure („**Short Exposures**") oder ein +1x-Exposure („**Normal Exposure**") auf die Referenzanlagen bieten. Bei Serien von ETP-Wertpapieren, die gehebelte Engagements und kurze Engagements anbieten, wird der Grad der Hebelwirkung oder der umgekehrten Hebelwirkung entweder (i) in den Index oder die Anlagestrategie oder (ii) direkt in die ETP-Wertpapiere eingebettet. Der Grad der Hebelwirkung, der für jede Serie von ETP-Wertpapieren gilt, wird durch den anwendbaren Hebelfaktor (der „**Hebelfaktor**") widergespiegelt. Es können auch Serien von ETP-Wertpapieren begeben werden, deren Ziel die Erwirtschaftung von Erträgen zur Finanzierung regelmäßiger Zinszahlungen ist (die "**Ertragsserien**"). Die Anlagestrategie einer Ertragsserie kann auch ein gehebeltes Engagement in den betreffenden Referenzwerten vorsehen, dessen Einzelheiten in der Beschreibung der Anlagestrategie enthalten sind.

Die Sicherungsvermögen in Bezug auf jede Serie der ETP-Wertpapiere sind:

- im Falle von gehebelten und normalen Engagements, bei denen die Referenzaktiva physische Vermögenswerte sind: die Referenzaktiva des anwendbaren Index oder der Anlagestrategie für diese ETP-Wertpapierreihe; Nebenaktiva (wie unten definiert); und jegliche Barmittel;
- im Falle von Short-Positionen, bei denen die Referenzaktiva physische Vermögenswerte sind: die Marktbewertung von Wertpapierkrediten, die Nebenaktiva und jegliche Barmittel;
- im Falle von ETP-Wertpapieren, bei denen es sich bei den Referenzaktiva um Terminkontrakte handelt: die Bewertung zum Marktwert der Terminkontrakte, die Zusatzaktiva und etwaige Barmittel,
- im Falle von Ertragsserien, bei denen es sich bei den Referenzaktiva um Optionskontrakte handelt: der Marktwert der Optionskontrakte; alle den Optionskontrakten zugrunde liegenden Vermögenswerte, die der Aussteller erworben hat, um (i) sein Engagement in den Optionen gemäß der Anlagestrategie abzusichern oder (ii) die Optionskontrakte physisch zu erfüllen; Nebenaktiva und jegliche Barmittel;
- Im Falle von Ertragsserien, bei denen es sich bei den Referenzaktiva um physische Vermögenswerte handelt: die Referenzaktiva der Anlagestrategie für diese ETP-Wertpapierreihe, Nebenaktiva und jegliche Barmittel

jeweils wie sie auf dem/den für diese Serie eingerichteten Margenkonto/en (das „**Margenkonto**" und die „**Sicherheiten**") gehalten werden.

Beträge, die einem Margenkonto in Bezug auf eine Serie von ETP-Wertpapieren gutgeschrieben werden, soweit sie nicht für Investitionen zur Nachbildung der Wertentwicklung des betreffenden Index für diese Serie oder für Investitionen in Übereinstimmung mit der Investitionsstrategie für diese Serie erforderlich sind, können auf Anweisung des Portfolioverwalters als Barguthaben auf dem Margenkonto geführt oder in Staatsschulden in der Währung des Nennwerts der ETP-Wertpapiere mit einer ursprünglichen Laufzeit von weniger als einem Monat, die von Standard & Poor's Ratings Services mit mindestens A-1 bewertet wird, und/oder von Moody's Investors Service Ltd. mit P-1 bewertet wird, investiert werden, und/oder F1 von Fitch Ratings Limited (die „**Zusatzaktiva**") bewertet wird.

Gegebenenfalls bezieht sich jede Serie von ETP-Wertpapieren auf die Wertentwicklung des entsprechenden Index oder der entsprechenden Anlagestrategie über einen täglichen, wöchentlichen, monatlichen Zeitraum oder einen anderen Zeitraum, der in den Endgültigen Bedingungen festgelegt ist (der „Ausgleichsperiode"). Am Ende jeder Wiederausgleichsperiode wird das Margenkonto neu aufgebaut, um die Wertentwicklung des Index oder der Anlagestrategie zu verfolgen.

Der Rückzahlungsbetrag der ETP-Wertpapiere wird aus der Liquidation der Sicherheiten, wie sie gemäß dem Leverage-Faktor dieser Serie von ETP-Wertpapieren gekauft oder verkauft wurden, abgeleitet.

In Bezug auf jede Ertragsserie leistet der Aussteller Zinszahlungen in Bezug auf die ETP-Schuldverschreibungen dieser Serie am jeweiligen Zinszahlungstag, wie in den Endgültigen Bedingungen angegeben.

Die ETP-Wertpapiere sind frei übertragbar.

Jede Serie von ETP-Wertpapieren gibt den Inhabern von ETP-Wertpapieren nur das Recht auf Beteiligung am Erlös der Liquidation eines proportionalen Anteils an den auf dem entsprechenden Margenkonto gehaltenen Deckungswerten in Bezug auf diese Serie, nach anteiligem Abzug aller Kosten und Aufwendungen, die dem Aussteller in Verbindung mit der Liquidation dieser Deckungswerte entstanden sind, dem anteiligen Abzug der Arrangeur-Gebühr und aller anwendbaren Margen-Zinsen, Wertpapierleihgebühren und Maklergebühren („Funding and Brokerage Fees"), die darauf anfallen_und im_Falle von Ertragsserein etwaigen anteiligen Anpassungen zur Berücksichtigung von Zinsbeträgen, die in Bezug auf die ETP-Wertpapiere zu zahlen sind. Eine solche Liquidation findet am letzten Rückzahlungstag (wie unten angegeben) oder nur unter bestimmten Umständen vor diesem Datum statt.

An bestimmten Bewertungstagen wird von der Feststellungsstelle ein „ETP-Wertpapier" berechnet, der den Wert der Sicherheiten in Bezug auf eine Serie von ETP-Wertpapieren widerspiegelt, der zur Berücksichtigung aller anwendbaren Gebühren und Kosten angepasst wird.

Für jede Serie wird der Aussteller eine Sicherheit über die Beleihungswerte in Bezug auf diese Serie zugunsten u.a. der Inhaber von ETP-Wertpapieren dieser Serie schaffen. Nach der Vollstreckung der von dem Aussteller in Bezug auf jede Serie gewährten Sicherheit wird der Treuhänder die Erlöse aus der Verwertung der Sicherheiten, die Gegenstand der Sicherheit sind, in der anwendbaren Rangfolge verwenden, wobei die den ETP-Sicherheitsinhabern geschuldeten Beträge allen Kosten, Gebühren, Ausgaben und allen anderen Beträgen nachrangig sind, einschließlich (ohne Einschränkung) der Kosten für die Vollstreckung und/oder Verwertung der dem Treuhänder selbst und jedem Empfänger geschuldeten Sicherheit, jeweils in Bezug auf die ETP-Sicherheitsinhaber.

Wenn in Bezug auf eine Serie von ETP-Wertpapieren der Netto-Erlös aus der Verwertung der vom Aussteller für diese Serie geschaffenen Sicherheit nicht ausreicht, um alle Beträge zu bezahlen, die der Aussteller den gesicherten Gläubigern (mit Ausnahme der Anbieter von Margin-Krediten) in Bezug auf diese Serie schuldet, stehen keine anderen Vermögenswerte des Ausstellers zur Verfügung, um einen eventuellen Fehlbetrag zu decken, und alle ausstehenden Forderungen dieser gesicherten Gläubiger werden gelöscht. Keine Partei (mit Ausnahme der Anbieter von Margin-Krediten) ist berechtigt, weitere Schritte gegen den Aussteller zu unternehmen, um weitere Beträge einzuziehen.

***Ausstellungsspezifische Zusammenfassung:***

*Anlageziel: Die LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy zu verfolgen, die darauf abzielt, monatliche Erträge durch den Verkauf von Optionen auf Super Micro Computer, Inc. zu generieren und eine Rendite auf Basis der gehaltenen Barmittel zu zahlen. Die Strategie kann auch Optionen zu Absicherungszwecken handeln.*

*Serie: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP*

*ISIN: XS3299465412*

*Anzahl der ETP-Wertpapiere: 15000*

*Die gemäß diesen Endgültigen Bedingungen ausgestellter ETP-Wertpapiere lauten auf US-Dollar.*

*Der Endfälligkeitstag der ETP-Wertpapiere ist der 19/03/2076 (der „Endgültige Rückzahlungstag").Jedes ETP-Wertpapier hat einen Kapitalbetrag von USD 10.00.*

*Wo werden die Wertpapiere gehandelt?*

***Ausstellungsspezifische Zusammenfassung:***

*Bei der Financial Conduct Authority (die „FCA") wurde beantragt, die Serie von ETP-Wertpapieren, für die diese endgültigen Bedingungen gelten, in die offizielle Liste der FCA aufzunehmen. Bei der Londoner Börse wurde beantragt, dass die Serie von ETP-Wertpapieren, für die diese endgültigen Bedingungen gelten, zum Handel am Hauptmarkt der Londoner Börse zugelassen wird.*

*Es wurde beantragt, dass die Serie von ETP-Wertpapieren, für die diese endgültigen Bedingungen gelten, zur Notierung und zum Handel an der Euronext Amsterdam zugelassen wird, der von Euronext Amsterdam betriebene geregelte Markt.*

*Die Zulassung der Serie von ETP-Wertpapieren, für die diese Endgültigen Bedingungen gelten, wurde bei der Frankfurter Wertpapierbörse zur Notierung und zum Handel auf der Deutschen Börse Xetra beantragt.*

*Was sind die Hauptrisiken, die für die Wertpapiere spezifisch sind?*

***EINE INVESTITION IN ETP-WERTPAPIERE IST MIT EINEM ERHEBLICHEN RISIKO VERBUNDEN.*** *Im Folgenden sind die Hauptrisikofaktoren aufgeführt, die von potenziellen Anlegern sorgfältig geprüft werden sollten, bevor sie sich für eine Investition in ETP-Wertpapiere entscheiden. Investoren sollten ihre eigenen Finanz-, Rechts-, Buchhaltungs- und Steuerberater zu den Risiken einer Investition in ETP-Wertpapiere konsultieren.*

*Marktpreis der ETP-Wertpapiere: Die ETP-Wertpapiere können eine lange Laufzeit haben, und der endgültige Rückzahlungstermin könnte bis zu 50 Jahre nach dem ursprünglichen Ausgabedatum der Serie liegen. Das einzige Mittel, mit dem ein Anleger einen Wert aus einem ETP-Wertpapier vor dessen endgültigem Rückzahlungstermin erzielen kann, besteht darin, es zu seinem damaligen Marktpreis in einer Sekundärmarkttransaktion zu verkaufen.*

*Market-Making durch autorisierte Teilnehmer: Anleger sind darauf angewiesen, dass ein oder mehrere autorisierte Teilnehmer einen Markt für ETP-Wertpapiere schaffen, um den Anlegern Liquidität zu verschaffen. Investoren sollten sich darüber im Klaren sein, dass kein autorisierter Teilnehmer verpflichtet ist, einen Markt für eine Reihe von ETP-Wertpapieren zu schaffen, und in Fällen, in denen ein autorisierter Teilnehmer als Market Maker für eine Reihe von ETP-Wertpapieren auftritt, kann dieser autorisierte Teilnehmer das Market Making jederzeit einstellen. Gibt es keine Zugelassenen Teilnehmer oder gelingt es dem/den Zugelassenen Teilnehmer(n) nicht, einen Markt für die ETP-Wertpapiere einer Serie zu schaffen, können die Anleger möglicherweise nicht in der Lage sein, solche ETP-Wertpapiere innerhalb eines kurzen Zeitraums oder zu einem Preis nahe dem ETP-Wertpapierwert für diese Serie zu verkaufen. Wenn die Anleger nicht in der Lage sind, die ETP-Wertpapiere zu verkaufen, können sie ihre Investition bis zum endgültigen Rückzahlungstermin nicht realisieren.*

***Ausstellungsspezifische Zusammenfassung***

*ETP-Wertpapiere, die mit einer Anlagestrategie verbunden sind: Jedes ETP-Wertpapier wird an die Wertentwicklung der Referenzanlagen, auf die sich diese Anlagestrategie bezieht, gebunden. Die Anleger haben keine Eigentumsrechte an den Referenzanlagen einer Anlagestrategie. Der bei der Rückzahlung der ETP-Wertpapiere zu zahlende Betrag hängt von der Liquidation der Sicherheiten in Bezug auf diese Serie ab.*

*Mit Eigenkapitaltiteln verbundene ETP – Wertpapiere: Die Risiken der mit Eigenkapitaltiteln verbundenen ETP - Wertpapiere bestehen unter anderem in der Möglichkeit wesentlicher Änderungen der entsprechenden Kapitalelemente. Der Wert der entsprechenden Kapitalelemente kann sich erhöhen oder eben senken, und der Wert eines relevanten Kapitalelements kann ihre Performance in einer Periode in der Vergangenheit nicht nachahmen. Es kann keine Zusicherung des Werts eines Kapitaltitels in der Zukunft oder des Weiterbestehens eines Kapitalelements, einer Schuld oder der damit verbundenen Gesellschaft geben. Dementsprechend müssen die voraussichtlichen Anleger, bevor sie eine Investitionsentscheidung bezüglich ETP - Wertpapiere treffen, sorgfältig erwägen, ob eine Anlage, deren Rendite von der Performance von Kapitaltiteln abhängt, für sie geeignet ist.*

*Aktiv verwaltete Investitionsstrategie: Die ETP-Wertpapierhalter sind nicht berechtigt, sich an die Verwaltung der „Sicherheiten" /Collateral Assets/ sowie der Serien von ETP - Wertpapieren zu beteiligen. Alle Entscheidungen bezüglich der Investition der Emissionszugänge aus den ETP - Wertpapieren werden gemäß der LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy getroffen. Sie können ETP - Wertpapiere nur dann erwerben, wenn Sie einverstanden sind, alle Aspekte der Verwaltung der „Sicherheiten" /Collateral Assets/ dem Portfolio - Verwalter gemäß der LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy zu überlassen. Ungünstige Ergebnisse der LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy können sich auf dem Wert der ETP - Wertpapiere negativ*

*auswirken, und das kann dazu führen, dass die ETP-Wertpapierhalter weniger oder wesentlich weniger als ihren anfänglichen Investitionsbetrag bekommen.*

*ETP-Wertpapiere, die an Short-Positionen in Put-Optionen gebunden sind: Der Verkauf von Put-Optionen setzt die ETP-Wertpapiere dem Risiko aus, dass der Preis des zugrunde liegenden Vermögenswerts der Put-Option am Ausübungstag unter den Ausübungspreis fällt. Der Aussteller kann die Put-Optionen auf abgescherter Basis abschließen, indem er genügend Barmittel zurücklegt, um die Verpflichtungen aus den Put-Optionen zu erfüllen. Der Aussteller darf jedoch keine liquiden Mittel halten, um sein Exposure aus den Put-Optionen zu decken, was zu einem Verlust oder einer vorzeitigen Auflösung führen kann, soweit die Put-Optionen ganz oder teilweise ungedeckt sind. Darüber hinaus kann der Aussteller, soweit die Put-Optionen physisch erfüllt werden, von Zeit zu Zeit verpflichtet sein, die zugrunde liegenden Vermögenswerte zu übernehmen. Der Aussteller, sofern er die zugrunde liegenden Vermögenswerte besitzt, ist dem Risiko ausgesetzt, dass der Preis der zugrunde liegenden Vermögenswerte sinkt, was zu einer Herabsetzung des ETP- Wertpapierwerts führen kann.*

***D Wichtige Informationen zum öffentlichen Angebot von Wertpapieren und/oder zur Zulassung zum Handel an einem geregelten Markt***

*Unter welchen Bedingungen und nach welchem Zeitplan kann ich in diese Wertpapiere investieren?*

*Die ETP-Wertpapiere werden von dem Aussteller nur autorisierten Teilnehmern zur Verfügung gestellt, die von dem Aussteller im Zusammenhang mit dem Programm ernannt wurden und die einen gültigen Zeichnungsauftrag an den Aussteller gestellt haben. Neuaustellungen von ETP-Wertpapieren werden in der Regel am zweiten Londoner Geschäftstag (ein Tag (nicht Samstag oder Sonntag), an dem Geschäftsbanken und Devisenmärkte Zahlungen in London abwickeln) nach dem Tag, an dem ein gültiger Zeichnungsauftrag bei dem Aussteller eingegangen ist, zusammen mit der entsprechenden Gebühr abgerechnet, sofern dieser Auftrag an diesem Tag vor 14.30 Uhr Londoner Zeit eingeht.*

*In Bezug auf jede Serie von ETP-Wertpapieren umfassen die von den Inhabern von ETP-Wertpapieren zu zahlenden Gebühren die folgenden Komponenten: (i) eine Arrangeur-Gebühr, die zu einem Satz von 0.55% pro Jahr des ETP-Wertpapierwertes, den ein ETP-Wertpapierinhaber hält, erhoben wird; (ii) die entsprechenden Finanzierungs- und Maklergebühren, die angepasst werden können; (iii) Steuern, Gebühren und andere Beträge, die an die irischen Revenue Commissioners zu zahlen sind; (iv) Beträge, die an den Margin-Darlehen Anbieter und den aktenkundigen Broker zu zahlen sind; und (v) die Kosten und Aufwendungen, die im Zusammenhang mit der Liquidation der Sicherungsgegenstände anfallen.*

*Der Aussteller wird diese Kosten an die Anleger weitergeben und damit den Wert ihrer Investition in die ETP-Wertpapiere reduzieren. Der Aussteller wird den Anlegern keine weiteren Kosten in Rechnung stellen.*

***Ausstellungsspezifische Zusammenfassung:***

Ein Angebot der ETP-Wertpapiere, das nicht von der Verpflichtung zur Veröffentlichung eines Prospekts gemäß der Verordnung (EU) 2017/1129 während des betreffenden Angebotszeitraums ausgenommen ist, kann in Irland, Italien, Deutschland, Frankreich, Spanien, den Niederlanden, Polen, Belgien, Schweden, Norwegen und Österreich erfolgen.

*Anlageziel:*

Die Gründe für das Angebot und die Verwendung der Erlöse sind die Gewinnerzielung und/oder die Absicherung.

***Ausstellungsspezifische Zusammenfassung:***

*Der geschätzte Nettobetrag des Ausstellungserlöses beträgt 70688.72 US-Dollar.*

Der Aussteller wird den Emissionserlös zur Finanzierung der zugehörigen Margenkonten verwenden, die gegebenenfalls zur Aufrechterhaltung von Positionen in den Referenzaktiva erforderlich sind, um (im Rahmen des praktisch Durchführbaren) die Rendite des Index nachzubilden oder die von der Serie referenzierte Anlagestrategie unter Berücksichtigung des anwendbaren Leverage-Faktors zu verfolgen. Beträge, die dem Margenkonto gutgeschrieben werden, können nach dem Ermessen des Portfolioverwalters auch als Barguthaben auf dem Margenkonto geführt oder in zusätzliche Vermögenswerte investiert werden.

Das Angebot von ETP-Wertpapieren unterliegt nicht einer Zeichnungsvereinbarung auf einer festen Verpflichtungsbasis.

Wesentliche Interessenkonflikte

Die autorisierten Teilnehmer und/oder ihre jeweiligen Partner können auf bestimmten Märkten aktive Händler sein. Diese Handelsaktivitäten können zu einem Konflikt zwischen den Inhabern der ETP-Wertpapiere und den Interessen der zugelassenen Teilnehmer und ihrer jeweiligen verbundenen Unternehmen an ihren eigenen Konten, an der Ermöglichung von Transaktionen, einschließlich Optionen und anderen Derivatgeschäften, für ihre Kunden und an den von ihnen verwalteten Konten führen.

Diese Handelsaktivitäten könnten, wenn sie den Wert eines Index oder einer Anlagestrategie, an die eine Reihe von ETP-Wertpapieren gebunden ist, beeinflussen, den Interessen der Inhaber von ETP-Wertpapieren abträglich sein. Die Autorisierten Teilnehmer und ihre jeweiligen Partner können auch zusätzliche Wertpapiere ausgeben oder übernehmen oder mit anderen Produkten handeln, deren Rendite an den Wert eines Index oder einer Anlagestrategie, die an eine Serie von ETP-Wertpapieren oder andere ähnliche Strategien gekoppelt ist, gebunden ist. Ein erhöhter Umfang der Anlage in diese Produkte kann sich negativ auf den Umfang eines Index oder einer Anlagestrategie, an den/die eine Serie von ETP-Wertpapieren gebunden ist, und damit auf den Betrag, der in Bezug auf diese Serie von ETP-Wertpapieren an ihrem angegebenen Fälligkeitstermin oder gegebenenfalls an einem früheren Rückzahlungstermin zu zahlen ist, sowie auf den Marktwert dieser ETP-Wertpapiere auswirken.

GWM Limited (die als Broker Dealer of Record und/oder Autorisierter Teilnehmer in Bezug auf eine Serie von ETP-Wertpapieren handeln kann), Flexinvest Limited (die als Portfolioadministrator handeln kann), FlexAdvisor Limited (die als Portfolioadministrator handeln kann) und die Bestimmungsstelle stehen im gemeinsamen Eigentum von Jose Gonzalez, der außerdem Direktor und letztendlicher Mehrheitsaktionär des Arrangers ist. Wenn diese Unternehmen tätig werden, haben sie nur die Pflichten und Verantwortlichkeiten, die in der jeweiligen Funktion ausdrücklich mit ihnen vereinbart wurden, und es wird ihnen nicht allein aufgrund der Zugehörigkeit zu einer in anderer Funktion handelnden Einheit nachgesagt, weitere Pflichten oder Verantwortlichkeiten zu haben oder einen anderen Sorgfaltsmaßstab einzuhalten, als in Bezug auf die jeweilige Funktion ausdrücklich vorgesehen.

**RÉSUMÉ 1 DU PROGRAMME D'EMISSION**

## A. Introduction et Mises en garde

Ce résumé doit être lu comme une introduction au prospectus de base de Leverage Share plc tel qu'approuvé par la Banque centrale d'Irlande (le ''Prospectus de base'' et ''l'Émetteur''). Toute décision d'investir dans des Titres ETP (définis ci-dessous) doit être fondée sur un examen du Prospectus de Base dans son ensemble par l'investisseur. **UN INVESTISSEUR PEUT PERDRE LA VALEUR DE TOUT SON INVESTISSEMENT OU UNE PARTIE DE CELUI-CI.** Lorsqu'une action concernant une information contenue dans le Prospectus de Base est présentée devant la justice, l'investisseur plaignant peut, au regard du droit national des États Membres, avoir à supporter les frais de traduction du Prospectus de Base avant le début de la procédure judiciaire. La responsabilité civile est attribuée uniquement aux personnes ayant préparé ce résumé, ainsi que sa traduction, mais uniquement si ce résumé est trompeur, inexact ou contradictoire par rapport aux autres parties du Prospectus de Base, ou s'il ne fournit pas, s'il est considéré conjointement avec les autres parties du Prospectus de Base, des informations clés permettant d'aider les investisseurs lorsqu'ils envisagent d'investir dans ces Titres ETP.

*Émetteur* : Leverage Shares Plc, 2 nd Floor, Block 5, Irish Life Centre, Abbey Street Lower Dublin 1, D01 P767 Irlande.

Site Internet: https://leverageshares.com

Téléphone : +353 1 2240300

LEI : 635400TLFJSNHVSOFH59

*Autorité Compétente :* Central Bank of Ireland, New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, Irlande

Site Internet: https://centralbank.ie

Téléphone: + 353 (0) 1 224 6000

*Date d'approbation du Prospectus de base: 11/06/2026. Supplément: 07/07/2026*

***Résumé Spécifique lié à l'Emission :***

*Titres: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP, ISIN: XS3299465412*

## B. Informations Utiles sur l'Émetteur

*Qui est l'Émetteur de ces Titres ?*

L'Émetteur est Leverage Shares PLC, une société anonyme domiciliée en Irlande, enregistrée sous la Companies Act 2014 d'Irlande, et immatriculée sous le numéro 597399. L'Émetteur fonctionne selon les lois d'Irlande. Le Legal Entity Identifier (LEI) de l'Émetteur est 635400TLFJSNHVSOFH59.

La principale activité décrite par l'Émetteur est l'émission et l'exécution de ses obligations sous les Titres échangeables en bourse adossés à des actifs mobiliers (les **''Titres ETP''**). L'Émetteur a établi un programme (le **''Programme''**), dans le Prospectus de Base, selon lequel des séries de Titres ETP (chacun une ''Série'') seront émises de temps en temps.

Toutes les actions émises par l'Émetteur sont directement ou indirectement détenues par Monument Trustees Limited, ayant son siège social au 57 Herbert Lane, Dublin 2, Irlande, et immatriculé sous le numéro 345558 (le **''Fiduciaire''**) selon les modalités de la déclaration de fiducie datant du 20 juin 2017 en vertu de laquelle le Fiduciaire détient le bénéfice des actions du trust pour des actions caritatives. L'Émetteur n'est pas directement ou indirectement détenu ou contrôlé par une autre partie du Programme.

Les Directeurs de l'Émetteur sont Neil Fleming et Ciarán Connolly.

Les auditeurs de l'Émetteur sont Grant Thornton, 18 City Quay, Dublin 2, Ireland, qui sont comptables agréés autorisés à pratiquer en Irlande et membre de l'Institute of Chartered Accountants in Ireland.

***Résumé Spécifique lié à l'Emission :***

*L'Émetteur a désigné les prestataires de service suivants dans le respect des Titres ETP :*

- *Apex Corporate Trustees (UK) Limited agira à titre de fiduciaire (le "**Fiduciaire**");*
- *Flexinvest Limited agira à titre de gestionnaire de portefeuille (le "**Gestionnaire de Portefeuille**");*
- *Interactive Brokers LLC et/ou Morgan Stanley & Co. LLC et/ou Pershing LLC agira à titre de fournisseur de prêt sur marge (le "**Fournisseur de Prêt sur Marge**");*
- *Leverage Shares Management Company Limited agira à titre d'arrangeur;*
- *U.S. Bank Europe DAC agira à titre d'agent d'émission et de paiement;*
- *U.S. Bank Europe DAC agira à titre de registraire;*
- *Calculation Agent Services LLC agira à titre d'agent de détermination;*
- *GWM Limited agira à titre de courtier négociant; et*
- *Les participants autorisés sont répertoriés sur le site web de l'émetteur.*

*Quelle sont les informations financières clés concernant l'Émetteur ?*

**Etat du résultat Global de Leverage Shares plc pour la période comptable**

| | 1-Juil-24 au 30-Juin-2025 USD - Vérifié | 1-Juil-23 au 30-Juin-2024 USD - Vérifié |
|---|---|---|
| Bénéfice net/(perte) | - 53,223 | 4,935 |

**Etat de la situation financière de Leverage Shares plc pour la période comptable révolue**

| | 30-Juin-2025 USD - Vérifié | 30-Juin-2024 USD- Vérifié |
|---|---|---|
| Totalité des actifs | 3,586,373,432 | 2,046,580,088 |
| Totalité des passifs | 3,586,439,659 | 2,046,593,092 |
| Actifs financiers désignés à la juste valeur par le biais du compte du résultat | 3,367,625,495 | 1,935,575,783 |
| Actifs financiers dérivés | 0 | 0 |
| Passifs financiers désignés à la juste valeur par le biais du compte du résultat | 1,368,044,139 | 790,712,170 |
| Passifs financiers dérivés | 0 | 0 |

*Quels sont les risques clés spécifiques à l'Émetteur ?*

**L'Émetteur est une entité à finalité spécifique:** L'Émetteur est une entité à finalité spécifique dont l'unique fonction est d'émettre des Titres ETP. Les seuls fonds de l'Émetteur visant à effectuer des paiements dans le respect d'une Série de Titres ETP sont les montants reçus par l'Émetteur pour la réalisation d'actifs (tels que définis ci-dessous). Pour chaque Série, l'Émetteur créera un titre sur les Actifs dans le respect de cette Série et pour le bénéfice, entre autres, des détenteurs de titres de cette Série.

Au cas où un titre crée par l'Émetteur est exercé, et que les bénéfices de cette exécution sont, après le paiement des créanciers de premier rang, insuffisants pour payer les montants dû aux détenteurs de Titres ETP, l'Émetteur n'aura aucune responsabilité, obligation ou dette pour tout manquement de paiement, et aucun détenteur de Titres ETP ou fiduciaire (ou tout autre partie agissant en leur nom) ne pourra prendre de mesures pour recouvrer les sommes.

**Réclamations du Fournisseur de Prêt sur Marge** : Les investisseurs doivent être conscients que les accords conclus entre l'Emetteur et les Fournisseurs de Prêt sur Marge (les « Contrats de Compte sur Marge LS »), ne contiennent pas de dispositions de recours limité en ce qui concerne les obligations de l'Émetteur. Il existe donc un risque que, en cas de réclamation d'un Fournisseur de Prêt sur Marge à l'encontre de l'Émetteur, en relation avec un Contrat de Compte sur Marge LS, si à la suite de la réalisation intégrale des Biens Garantis (que ce soit par voie de liquidation ou d'exécution) à l'égard d'une Série de Titres ETP et des liquidités disponibles conformément aux

ordre de priorités de l'Acte Fiduciaire, une plainte contre l'Émetteur reste en suspens, une telle plainte peut être entamée contre les actifs relevant des autres Titres ETP en circulation sur une base proportionnelle. GWM Limited peut agir à titre de courtier négociant concernant certaines Séries de Titres ETP (Le Courtier Négociant) cependant s'est engagé à indemniser l'Émetteur pour toute perte, coût, plainte, action en justice, revendication ou dépense que l'Émetteur peut encourir résultant de plaintes venant du Fournisseur de Prêt sur Marge.

### C. Informations clés sur les Titres

*Quelles sont les caractéristiques principales des Titres ?*

Chaque Série de Titre ETP sera liée à un indice (l' "I**ndice**") ou alors suivra une stratégie d'investissement qui définira la manière par laquelle le produit net de l'émission de Titres ETP sera investi accompagné de tout effet de levier employé dans le respect d'une telle stratégie d'investissement (la "**Stratégie d'Investissement**"). L'Indice ou la Stratégie d'Investissement mentionnera un ou plusieurs actifs (les "**Actifs de Référence**") qui peuvent consister en (i) titres de capital, (ii) titres de créance, (iii) titres à revenu fixe, (iv) parts d'ETF (exchange traded funds), (v) fonds communs de placement (éléments (i) à (v)), ('**'Actifs Physiques**'') ou (vi) contrats à terme et (vii) les contrats d'options.

Les Séries de Titres ETP peuvent offrir une exposition à la hausse avec un effet de levier (**''Expositions à Effet de Levier''**), une exposition à la baisse (''**Expositions à la baisse''**) ou exposition +1x (''**Expositions Normales''**) aux Actifs de Référence. Par rapport aux Séries de Titres ETP offrant des Expositions à Effet de Levier et des expositions à la baisse, le degré d'effet de levier ou exposition à la baisse sera intégré soit dans (i) l'Indice ou la Stratégie d'Investissement ; soit (ii) directement dans les Titres ETP. Le degré d'effet de levier qui s'appliquera à chaque Série de Titres ETP sera reflété dans l'effet de levier applicable (l' "**Effet de Levier"**). Des séries de titres ETP peuvent également être émises dans le but de générer un revenu pour financer les paiements d'intérêts périodiques (l" «I**ncome Series** »). La stratégie d'investissement d'une Income Series peut également prévoir une exposition avec effet de levier aux actifs de référence concernés, dont les détails seront inclus dans la description de la stratégie d'investissement.

Les actifs de garantie relatifs à chaque Série de Titres ETP sont :

- dans le cas des Expositions à Effet de Levier et des Expositions Normales où les Actifs de Référence sont des Actifs Physiques : Les Actifs de Référence de l'Indice ou de la Stratégie d'Investissement applicables à chaque Séries de Titres ETP ; des Actifs Accessoires (tels que définis ci-dessous) ; et tout argent liquide ;

- dans le cas des expositions à la baisse où les Actifs de Référence sont des Actifs Physiques : la valeur du marché des prêts de titres ; les Actifs Accessoires ; et tout argent liquide ;

- dans le cas de Titres ETP où les Actifs de Référence sont des contrats à terme : la valeur du marché des contrats à terme ; les Actifs Accessoires ; et tout argent liquide,

- dans le cas d'Income Series où les actifs de référence sont des contrats d'options : la valeur marchande des contrats d'options ; tout actif sous-jacent aux contrats d'options acquis par l'Émetteur pour (i) couvrir son exposition au titre des options conformément à la Stratégie d'investissement ou (ii) à la suite du règlement physique des contrats d'options ; Actifs auxiliaires ; et tout argent liquide ;

- dans le cas d'Income Series où les actifs de référence sont des actifs physiques : les actifs de référence de la stratégie d'investissement pour cette série de titres ETP ; Actifs connexes ; et toutes liquidités.

dans chaque cas annoncé dans le compte sur marge établi par cette Série (le ''**Compte sur Marge''** et les ''**Actifs donnés en Garantie**'').

Des soldes créditeurs sur un Compte sur Marge relatifs à une Série de Titres ETP, dans la mesure où ils ne sont pas requis pour un investissement qui répliquerait la performance de l'Indice pertinent à cette Série ou pour un investissement en conformité à la Stratégie d'Investissement de cette Série, peuvent sur instruction du Gestionnaire de Portefeuille être conservés comme soldes dans le Compte sur Marge ou investis en dette souveraine dans la monnaie de libellé des Titres ETP assortis d'une échéance inférieure à un mois et notés au minimum A-1 par Standard & Poor's Ratings Services, et/ou P-1 par P-1 par Moody's Investors Service Ltd, et/ou F1 par Fitch Ratings Limited (les ''**Actifs Accessoires''**).

Le cas échéant, chaque Série de Titres ETP mentionnera la performance de l'Indice ou de la Stratégie d'Investissement associé et ce, de manière quotidienne, hebdomadaire, mensuelle ou sur une tout autre période indiquée dans les Conditions Finales (la ''**Période de Rééquilibrage''**). A la fin de chaque Période de Rééquilibrage le Compte sur Marge sera reconstitué afin de tracer la performance de l'Indice ou de continuer la Stratégie d'Investissement.

Le montant du remboursement des Titres ETP proviendra de la liquidation des Garanties, achetées ou vendues suivant l'Effet de Levier de ces Séries de Titres ETP.

Pour chaque Income Series, l'Émetteur effectuera les paiements des montants d'intérêts au titre des Titres ETP de cette Série à la date de paiement des intérêts concernée, comme indiqué dans les Conditions Définitives.

Les Titres ETP sont librement négociables.

Chaque Série de Titres ETP donnera uniquement aux détenteurs de Titres ETP les droits de participer au produit de la liquidation avec une portion pro rata, relative aux détenteurs de Titres ETP, des Garanties détenues dans le Compte sur Marge relatif à chaque Série, après le prélèvement pro rata de tous les coûts et dépenses encourus par l'Émetteur en relation à la liquidation de ces Garanties, le prélèvement pro rata des Frais d'Arrangement et toute marge d'intérêt, des frais de prêt de titres et des frais de courtage (''**Frais de Financement et de Courtage**'') s'y rapportant et dans le cas des Income Series, tout ajustement au prorata pour tenir compte de tout montant d'intérêt à payer à l'égard des titres ETP. Cette liquidation se fera à la date de l'Échéance Finale (comme spécifié ci-dessous) ou dans des circonstances particulières avant cette date.

Pour les jours spécifiques d'évaluation, une ''**Valeur des Titres ETP**'' sera calculée par un Agent de Détermination qui reflétera la valeur de sûreté relative aux Titres ETP qui sera rajustée pour prendre en compte les frais et dépenses applicables.

Pour chaque Série, l'Émetteur créera une sûreté sur les garanties relatives à cette Série pour le bénéfice, entre autres, des détenteurs de Titres ETP de cette Série. Après la mise en place des garanties accordées par l'Émetteur au regard de chaque Série, le Fiduciaire appliquera le produit de la réalisation des Garanties dans l'ordre applicable des priorités sous lesquelles les sommes dues aux détenteurs de Titres ETP seront subordonnées de tous coût, frais, dépenses et tous les autres montants incluant (de façon non restrictive) les coûts de la mise en œuvre et/ou de la réalisation de la sûreté à cause du Fiduciaire ou tout autre récepteur, dans chaque cas lié aux détenteurs de Titres ETP.

Si, en relation avec une Série de Titre ETP, le produit net de la réalisation de la sûreté créée relative à cette Série par l'Émetteur est insuffisant pour couvrir les coûts dus par l'Émetteur aux créanciers garantis (autre que le(s) Fournisseur(s) de Prêt sur Marge ) relatifs à cette Série, aucun autre actif de l'Émetteur ne servira à couvrir ce déficit et toute revendication de ces créanciers garantis seront étouffées. Aucune partie (autre que le(s) Fournisseur(s) de Prêt sur Marge ) ne pourra prendre des mesures supplémentaires contre l'Émetteur pour recouvrer une quelconque somme.

**Résumé Spécifique lié à l'Émission :**

*Objectif d'Investissement: Poursuivre la LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy, qui vise à générer un revenu mensuel en vendant des options sur Super Micro Computer, Inc. et en versant un rendement basé sur les liquidités détenues. La stratégie peut également négocier des options à des fins de couverture.*
*Série: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP.*

*ISIN: XS3299465412*

*Nombre de Titres ETP: 15000*

*Les Titres ETP émis en vertu de ces Conditions Finales sont libellés en Dollars Américains.*

*La date d'échéance finale des Titres ETP est 19/03/2076 (la "Date d'Échéance Finale").Chaque Titre ETP a un Montant Nominal de USD 10.00.*

*Où les Titres seront-ils négociés ?*

***Résumé Spécifique lié à l'Émission :***

Une demande a été déposée à la Financial Conduct Authority (la ''FCA'') pour que les Séries de Titres ETP pour lesquelles ces Conditions Finales s'appliquent soient admises sur la Liste Officielle de la FCA. Une demande a été déposée à la Bourse de Londres pour que les Séries de Titres ETP pour lesquelles ces Conditions Finales s'appliquent soient admises à la négociation du Main Market de la Bourse de Londres.

Une demande a été faite pour que les Séries de Titres ETP pour lesquelles ces Conditions Finales s'appliquent soient admises à l'inscription et la négociation à Euronext Amsterdam, le marché régulé géré par Euronext Amsterdam.

Une demande a été déposée auprès de la Bourse de Francfort (Frankfurter Wertpapierbörse) pour que la série de Titres ETP auxquelles s'appliquent ces Conditions Définitives soit admise à la cotation et à la négociation sur

Deutsche Börse Xetra.

*Quels sont les risques clés spécifiques aux Titres ?*

**UN INVESTISSEMENT DANS DES TITRES ETP IMPLIQUE UN DEGRÉ DE RISQUE IMPORTANT.** Les facteurs de risques clés se trouvent ci-dessous et doivent être attentivement examinés par les investisseurs potentiels avant de s'engager à investir dans des Titres ETP. Les investisseurs doivent consulter leurs propres conseillers financiers, légaux, comptables, et fiscaux sur les risques d'un investissement dans des Titres ETP.

Prix du marché des Titres ETP: Les Titres ETP peuvent avoir une maturité à long terme et leur Date d'Échéance Finale peut aller jusqu'à 50 ans depuis la Date d'Émission de la Série. Le seul moyen pour un investisseur de réaliser une valorisation d'un Titre ETP avant de sa Date d'Échéance Finale sera de le vendre à son prix de marché lors d'une opération sur un marché secondaire.

Tenue de marché par les Participants Autorisés : Les investisseurs sont dépendants du fait qu'il puisse y avoir un ou plusieurs Participants Autorisés à la tenue d'un marché pour les Titres ETP afin d'offrir aux investisseurs de la liquidité. Les investisseurs doivent être conscients qu'aucun Participant Autorisé n'est obligé de tenir un marché pour n'importe quelle Série de Titres ETP et au cas où un Participant Autorisé agit comme teneur de marché relatif à une Série de Titres ETP, un tel Participant Autorisé peut se désister à tenir un marché à tout moment. S'il n'y a aucun Participant Autorisé, ou si un Participant Autorisé ne parvient pas à tenir un marché pour les Titres ETP d'une Série, les investisseurs pourraient ne pas être en mesure de vendre des Titres ETP sur une courte période de temps, ou à un prix se rapprochant de la Valeur des Titres ETP de cette Série. Si les investisseurs sont incapables de vendre les Titres ETP, ils ne pourront pas réaliser leur investissement avant la Date d'Échéance Finale.

Résumé Spécifique lié à l'Émission

*Les Titres ETP liés à la Stratégie d'investissement: Chaque Titre ETP est lié à la performance des Actifs de Référence indiqués dans leur Stratégie d'Investissement. Les investisseurs n'ont aucun droit de propriété sur les Actifs de Référence d'une Stratégie d'Investissement. Le montant payable au moment du remboursement des Titres ETP dépendra de la liquidation des Garanties liée à cette Série.*

*Titres ETP liés à des titres de participation : Les risques d'un Titre ETP lié à des titres de participation peuvent inclure, mais ne sont pas limités à la possibilité de changements significatifs dans le(s) prix des actions concernées. La valeur des actions concernées peut évoluer à la baisse comme à la hausse et la valeur de toute action pertinente à une date quelconque peut ne pas refléter leur performance au cours d'une période précédente. Il ne peut y avoir aucune assurance quant à la valeur future d'un titre de participation ou de l'existence continue d'une participation, d'une dette ou de sa société liée. Par conséquent, avant de prendre une décision d'investissement concernant les Titres ETP, les investisseurs potentiels doivent examiner attentivement si un investissement, dont le rendement dépendra de la performance des titres de participation, leur convient.*

*Une stratégie d'investissement activement gérée : les Porteurs de titres ETP n'ont pas le droit de prendre part à la gestion des actifs en garantie d'une série de titres ETP. Toutes les décisions concernant l'investissement du produit de l'émission des Titres ETP seront prises conformément à la LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. L'acheteur de Titres ETP doit être disposé à confier tous les aspects de la gestion des Actifs en garantie à l'Administrateur de portefeuille, afin que ce-dernier investisse conformément à la LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. Une mauvaise performance de la LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy pourrait avoir un impact négatif sur la valeur des Titres ETP, ce qui pourrait amener à ce que les Porteurs de Titres ETP récupèrent moins, voire sensiblement moins que leur investissement initial.*

*Titres ETP liés à des positions courtes dans des options de vente : la vente d'options de vente expose les Titres ETP au risque que le prix de l'Actif sous-jacent de l'option de vente tombe en dessous de son Prix d'exercice à la Date d'exercice. L'Émetteur peut conclure des options de vente sur une base couverte en mettant de côté suffisamment de liquidités pour faire face à ses obligations au titre des options de vente. Cependant, l'Émetteur peut ne pas détenir de liquidités pour couvrir son exposition au titre des options de vente, ce qui peut entraîner une perte ou un dénouement anticipé dans la mesure où les options de vente sont entièrement ou partiellement découvertes. En outre, dans la mesure où les options de vente sont réglées physiquement, l'Émetteur quelquefois peut être tenu de prendre livraison des Actifs sous-jacents. Dans la mesure où il possède les Actifs sous-jacents, l'Émetteur sera exposé au risque de baisse du prix des Actifs sous-jacents, ce qui peut entraîner une diminution de la Valeur du Titre ETP.*

### D. Informations clés sur l'Offre au Public de Titres et/ou l'Admission à la Négociation sur un Marché Régulé

*Sous quelles conditions et avec quel échéancier puis-je investir dans ce titre ?*

Les Titres ETP sont rendus disponibles à la souscription par l'Émetteur uniquement aux Participants Autorisés

désignés par l'Émetteur en relation avec le Programme, et qui ont soumis une demande de souscription valide à l'Émetteur. Les nouveaux Émetteurs de Titres ETP sont généralement établis le deuxième Jour Ouvrable (de référence à Londres) (un jour (hormis samedi ou dimanche) où les banques commerciales et les marchés des changes effectuent les paiements à Londres) suivant la date à laquelle l'Émetteur reçoit une demande de souscription valide ainsi que les frais exigibles, à condition que cette demande soit reçue le jour même avant 14h30, heure de Londres.

En ce qui concerne chaque Série de Titres ETP, les frais payables par les détenteurs de Titres ETP comprennent les composants suivants : (i) des frais d'arrangement imputés à un taux de 0.55% par an de la Valeur du Titre ETP détenu par le Détenteur de Titre ETP; (ii) des Frais adéquats de Détention et de Courtage soumis à des ajustements ; (iii) des impôts, des frais et tous les autres montants à payer aux Irish Revenue Commissioners ; (iv) des montants à payer au Fournisseur de Prêt sur Marge et au Broker Dealer of Record ; et (v) les coûts et les dépenses encourus liés à la liquidation des Garanties.

L'Émetteur transmettra ces coûts aux investisseurs, et par conséquent, réduira la valeur de leur investissement dans les Titres ETP. Aucun autre coût ne sera facturé aux investisseurs par l'Émetteur.

***Résumé Spécifique lié à l'Émission :***

Une offre des Titres ETP qui ne bénéficie pas d'une exemption du requis de publication d'un prospectus en vertu du règlement (UE) 2017/1129 pendant la période d'offre concernée peut être réalisée en Irlande, en Italie, en Allemagne, en France, en Espagne, aux Pays-Bas, en Pologne, en Belgique, en Suède, en Norvège et en Autriche.

*Pourquoi ce prospectus a-t-il été établi ?*

Les raisons de cette offre et de l'utilisation du produit sont la réalisation de bénéfices et/ou la couverture.

***Résumé Spécifique lié à l'Émission :***

*Le montant net estimé du produit de l'émission est 70688.72 Dollars Américains.*

l'Émetteur utilisera le produit de l'émission pour financer les Comptes sur Marges associés tel que requis pour entretenir les positions des Actifs de Référence afin de reproduire (dans la mesure du possible) le rendement de l'Indice ou de poursuivre la Stratégie d'investissement référencée par la Série en prenant en compte l'Effet de Levier applicable. Les montants inscrits au crédit du Compte sur Marge peuvent aussi, à la discrétion du Gestionnaire de Portefeuille, être conservés comme soldes en espèce dans le Compte sur Marge ou être investis dans des Actifs Accessoires.

L'offre de Titres ETP n'est pas soumise à une convention de prise ferme avec engagement ferme.

*Conflits d'Intérêts*

Les Participants Autorisés et/ou leurs filiales respectives peuvent être des traders actifs dans certains marchés. Ces activités de trading peuvent présenter un conflit d'intérêts entre les détenteurs de Titres ETP et les intérêts que les Participants Autorisés et leurs filiales respectivement peuvent avoir dans leurs comptes propriétaires, en facilitant des transactions, notamment des options et des transactions sur instruments dérivés, pour les clients et les comptes qu'ils gèrent. Ces activités de trading, si elles ont une influence sur la valeur de l'Index ou de la Stratégie d'Investissement à laquelle une Série de Titres ETP est liée, peuvent être défavorables aux intérêts des détenteurs de Titres ETP. Les Participants Autorisés et leurs filiales respectives peuvent également émettre ou souscrire des titres additionnels ou échanger d'autres produits dont le rendement est rattaché à la valeur de l'Indice ou de la Stratégie d'Investissement ou tout autre stratégie lié à une Série de Titres ETP. Une augmentation du niveau d'investissement sur ces produits peut affecter de manière négative le niveau de l'Indice ou de la Stratégie d'Investissement lié à la Série de Titres ETP, et par conséquent, le montant payable relatif à cette Série de Titres ETP à leur date d'échéance fixée ou avant une date de remboursement, dans la mesure du possible, et la valeur du marché de ces Titres ETP.

GWM Limited (pouvant agir en qualité de Broker Dealer of Record et/ou de Participant Autorisé à l'égard d'une Série de Titres ETP), Flexinvest Limited (pouvant agir en qualité d'Administrateur de Portefeuille), FlexAdvisor Limited (pouvant agir en qualité d'Administrateur de Portefeuille) et l'Agent de Détermination sont sous la propriété commune de Jose Gonzalez, qui est également administrateur et actionnaire majoritaire ultime de l'Arrangeur. Lorsque ces entités interviennent, elles n'assument que les devoirs et responsabilités expressément convenus dans la fonction concernée et ne seront pas, du seul fait d'être liées à une entité agissant dans une autre fonction, réputées avoir d'autres devoirs ou responsabilités ni tenues à un niveau de diligence autre que celui expressément prévu pour chacune de ces fonctions

## ANEKS 1–SZCZEGÓŁOWE PODSUMOWANIE PROBLEMU

### A Wprowadzenie i ostrzeżenia

Niniejsze podsumowanie należy odczytywać jako wprowadzenie do prospektu podstawowego Leverage Shares plc zatwierdzone przez Bank centralny of Irlandii („**Prospekt Podstawowy**" i „**Emitent**"). Każda decyzja o zainwestowaniu w papiery wartościowe ETP (zgodnie z definicją poniżej) powinna opierać się na rozpatrzenie Prospektu Podstawowego jako całość przez inwestora. **INWESTOR MOŻE STRACIĆ WARTOŚĆ CAŁEJ INWESTYCJI LUB JEJ CZĘŚCI.** W przypadku wniesienia do sądu powództwa dotyczącego informacji zawartych w Prospekcie Podstawowym, powód inwestor może, zgodnie z ustawodawstwem krajowym Państw Członkowskich, ponieść koszty przetłumaczenia Prospektu Podstawowego przed wszczęciem postępowania sądowego. Odpowiedzialność cywilna dotyczy tylko tych osób, które złożyły podsumowanie, w tym jego tłumaczenie, ale tylko w przypadku, gdy podsumowanie to wprowadza w błąd, jest niedokładne lub niespójne, gdy jest czytane razem z innymi częściami Prospektu Podstawowego lub nie dostarcza, gdy jest czytane razem z inne części Prospektu Podstawowego, kluczowych informacji mających pomóc inwestorom w podejmowaniu decyzji o inwestowaniu w papiery wartościowe ETP.

*Emitent:* Leverage Shares Plc, 2nd Floor, Block 5, Irish Life Centre, Abbey Street Lower, Dublin 1, D01 P767, Irlandia.
Strona internetowa: https://leverageshares.com
Telefon: +353 1 2240300
LEI: 635400TLFJSNHVSOFH59

*Właściwy organ:* Central Bank of Ireland, New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, Irlandia
Strona internetowa: https://centralbank.ie
Telefon: + 353 (0) 1 224 6000

*Data zatwierdzenia Prospektu Podstawowego:* 11/06/2026. Suplement: 07/07/2026

***Szczegółowe podsumowanie problemu:***

*Papiery wartościowe: Seria: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP, ISIN: XS3299465412*

### B Kluczowe informacje o Emitencie

*Kim jest Emitent Papierów Wartościowych?*

Emitentem jest Leverage Shares PLC, spółką akcyjną z siedzibą w Irlandii, utworzoną na podstawie Irlandzkiej Ustawy o spółkach z 2014 r. o numerze rejestracyjnym 597399. Emitent działa na podstawie prawa irlandzkiego. Numer LEI Emitenta to 635400TLFJSNHVSOFH59.

Opisywaną podstawową działalnością Emitenta jest emisja i realizacja zobowiązań wynikających z zabezpieczonych papierów wartościowych będących przedmiotem obrotu giełdowego („**Papiery Wartościowe ETP**"). Emitent ustanowił program („**Program**") opisany w Prospekcie Podstawowym, w ramach którego mogą być okresowo emitowane serie Papierów Wartościowych ETP (każda „**Seria**").

Wszystkie wyemitowane akcje Emitenta są bezpośrednio lub pośrednio w posiadaniu Monument Trustees Limited, z siedzibą pod adresem 57 Herbert Lane, Dublin 2, Irlandia i numerem rejestracyjnym 345558 („**Powiernik akcji**") na warunkach oświadczenia powierniczego z dnia 20 czerwca 2017 r., zgodnie z którym Powiernik Akcji posiada akcje powiernicze na cele charytatywne. Emitent nie jest bezpośrednio ani pośrednio posiadany ani nie jest kontrolowany przez żadną inną stronę Programu.

Dyrektorami Emitenta są Neil Fleming i Ciarán Connolly.

Audytorami Emitenta są, Grant Thornton, 18 City Quay, Dublin 2, Irlandia, którzy są biegłymi rewidentami posiadającymi kwalifikacje do wykonywania zawodu w Irlandii oraz członkami Instytutu Biegłych Rewidentów (Institute of Chartered Accountants) w Irlandii.

***Szczegółowe Podsumowanie Problemu:***

*Emitent wyznaczył następujących usługodawców w zakresie Papierów Wartościowych ETP:*

- *Apex Corporate Trustees (UK) Limited będzie działał jako powiernik („**Powiernik**");*
- *Flexinvest Limited będzie pełnić funkcję administratora portfela („**Administrator portfela**");*

- *Interactive Brokers LLC i/lub Morgan Stanley & Co. LLC i/lub Pershing LLC będą działać jako dostawcy pożyczki pod zastaw zabezpieczenia ("**Dostawcy pożyczki pod zastaw**");*
- *Leverage Shares Management Company Limited będzie działać jako organizator;*
- *U.S. Bank Europe DAC będzie pełnić rolę agenta wystawiającego i płatniczego;*
- *U.S. Bank Europe DAC będzie pełnić funkcję rejestratora;*
- *Calculation Agent Services LLC będzie działać jako agent ustalający;*
- *GWM Limited będzie pełnić rolę zarejestrowanego pośrednika; oraz*
- *Lista uczestników autoryzowanych jest dostępna na stronie internetowej emitenta*
-

*Jakie są kluczowe informacje finansowe dotyczące Emitenta?*

**Sprawozdanie z całkowitych dochodów Leverage Shares plc za okres obrotowy**

| | 1-lipca-24<br>do<br>30-Czerwca-2025<br>USD - Audytowane | 1-lipca-23<br>do<br>30-Czerwca-2024<br>USD - Audytowane |
|---|---|---|
| Zysk/(strata) netto | - 53,223 | 4,935 |

**Sprawozdanie z sytuacji finansowej Leverage Shares plc za okres obrotowy zakończony**

| | 30-Czerwca-2025<br>USD - Audytowane | 30-Czerwca-2024<br>USD- Audytowane |
|---|---|---|
| Aktywa ogółem | 3,586,373,432 | 2,046,580,088 |
| Zobowiązania ogółem | 3,586,439,659 | 2,046,593,092 |
| Aktywa finansowe wyceniane w wartości godziwej przez wynik finansowy | 3,367,625,495 | 1,935,575,783 |
| Pochodne aktywa finansowe | 0 | 0 |
| Zobowiązania finansowe wyceniane w wartości godziwej przez wynik finansowy | 1,368,044,139 | 790,712,170 |
| Pochodne zobowiązania finansowe | 0 | 0 |

*Jakie są główne ryzyka specyficzne dla Emitenta?*

**Emitent jest podmiotem specjalnego przeznaczenia:** Emitent jest podmiotem specjalnego przeznaczenia, którego jedynym przedmiotem działalności jest emisja Papierów Wartościowych ETP. Jedynymi środkami Emitenta na dokonywanie płatności z tytułu Serii Papierów Wartościowych ETP są kwoty otrzymane przez Emitenta z realizacji Aktywów Zabezpieczających (zdefiniowanych poniżej).

Dla każdej Serii Emitent ustanowi zabezpieczenie na Aktywach Zabezpieczających w odniesieniu do tych Serii na rzecz, między innymi, Posiadaczy Papierów Wartościowych ETP tych Serii. W przypadku, gdy zabezpieczenie ustanowione przez Emitenta zostanie wyegzekwowane, a wpływy z takiej egzekucji po dokonaniu płatności na rzecz wszystkich uprzywilejowanych wierzycieli będą niewystarczające do pełnej zapłaty wszystkich kwot należnych takim Posiadaczom Papierów Wartościowych ETP, Emitent nie będzie ponosić odpowiedzialności, zobowiązanie lub dług z tytułu niedoboru płatności i żaden z Posiadaczy Papierów Wartościowych ETP ani Powiernik (ani żadna inna strona działająca w ich imieniu) nie może podejmować żadnych dalszych działań w celu odzyskania takich kwot.

**Roszczenia Dostawcy Pożyczki pod zastaw**: Inwestorzy powinni mieć świadomość, że umowy, zawarte między Emitentem a Dostawcami kredytu pod zastaw (dalej: „**Umowy rachunku zabezpieczającego LS**") nie zawierają postanowień o ograniczonym regresie w odniesieniu do zobowiązań Emitenta. Istnieje zatem ryzyko, że w odniesieniu do roszczenia wobec Emitenta przez Dostawcę kredytu pod zastaw, w związku z Umową rachunku zabezpieczającego LS, jeżeli po zrealizowaniu w całości Zabezpieczonego Mienia (w drodze likwidacji lub egzekucji) z tytułu Serii Papierów Wartościowych ETP i wykorzystania dostępnej gotówki zgodnie z mającymi zastosowanie

porządkami pierwszeństwa i Umową Powierniczą, roszczenie pozostaje niespłacone wobec Emitenta, roszczenie takie może być dochodzone w stosunku do aktywów przypadających na inne niespłacone Serie Papierów Wartościowych ETP, na *zasadzie proporcjonalności*. GWM Limited, która może działać jako wyznaczony makler w odniesieniu do niektórych Serii Papierów Wartościowych ETP („**Wyznaczony Makler**"), zgodził się jednak zwolnić Emitenta z odpowiedzialności za wszelkie straty, koszty, roszczenia, działania, żądania lub wydatki jakie Emitent może ponieść w wyniku takich roszczeń ze strony Dostawcy Pożyczki pod zastaw.

## C Kluczowe informacje o papierach wartościowych

*Jakie są główne cechy Papierów Wartościowych?*

Każda seria Papierów Wartościowych ETP będzie powiązana z indeksem („**Indeks**") lub będzie realizowała strategię inwestycyjną opisującą sposób, w jaki wpływy z emisji Papierów Wartościowych ETP zostaną zainwestowane wraz z jakąkolwiek dźwignią, która zostanie zastosowana w odniesieniu do takiej strategii inwestycyjnej („**Strategia Inwestycyjna**"). Indeks lub Strategia Inwestycyjna będzie odnosić się do jednego lub więcej aktywów („**Aktywa Referencyjne**"), które mogą składać się z (i) kapitałowych papierów wartościowych, (ii) dłużnych papierów wartościowych, (iii) papierów wartościowych o stałym dochodzie, (iv) jednostek w funduszach giełdowych, (v) Fundusze wspólne ( pozycje od (i) do (v), („**Aktywa fizyczne**") lub (vi) kontrakty futures

Serie Papierów Wartościowych ETP mogą oferować lewarowaną długą ekspozycję („**Ekspozycje lewarowane**"), krótką odwróconą ekspozycję lewarowaną („**Krótkie ekspozycje**") lub +1x ekspozycję („**Ekspozycje normalne**") na Aktywa Referencyjne. W odniesieniu do Serii Papierów Wartościowych ETP oferujących ekspozycje lewarowane i ekspozycje krótkie, stopień lewarowania lub odwróconej dźwigni finansowej będzie osadzony w (i) Indeksie lub Strategii Inwestycyjnej; lub (ii) bezpośrednio w Papierach Wartościowych ETP. Stopień dźwigni, który będzie miał zastosowanie do każdej Serii Papierów Wartościowych ETP zostanie odzwierciedlony w odpowiednim współczynniku dźwigni („**Współczynnik dźwigni**"). Można również emitować serie Papierów Wartościowych ETP, których celem jest generowanie dochodu, żeby sfinansować okresowych płatności odsetek („Seria Dochodowa"). Strategia inwestycyjna serii dochodowej może również przewidywać ekspozycję lewarowaną na odpowiednie Aktywa Referencyjne, której szczegóły zostaną zawarte w opisie Strategii Inwestycyjnej.

Aktywa zabezpieczające w odniesieniu do każdej Serii Papierów Wartościowych ETP są:

- w przypadku Ekspozycji lewarowanych i Ekspozycji normalnych, gdzie Aktywa Referencyjne są Aktywami Fizycznymi: Aktywa Referencyjne odpowiedniego Indeksu lub Strategii Inwestycyjnej dla takiej Serii Papierów Wartościowych ETP; Aktywa Dodatkowe (zdefiniowane poniżej); oraz wszelkie środki pieniężne;

- w przypadku Krótkich ekspozycji, gdzie Aktywami Referencyjnymi są Aktywa Fizyczne: wycena wartości rynkowej pożyczek papierów wartościowych; Aktywa pomocnicze; oraz wszelkie środki pieniężne;

- w przypadku Papierów Wartościowych ETP, gdzie Aktywami Referencyjnymi są kontrakty futures: wycena wartości rynkowej kontraktów futures; Aktywa pomocnicze; i wszelkie środki pieniężne.

- w przypadku Serii Dochodowej, gdzie Aktywami Referencyjnymi są kontrakty options: wycena wartości rynkowej kontraktów options; co aktywa bazowe kontraktów options nabytych przez Emitenta w celu (i) pokrycia jego ekspozycji wynikającej z opcji (options) zgodnie ze Strategią inwestycyjną lub (ii) w wyniku fizycznego rozliczenia kontraktów options; Aktywa pomocnicze; i wszelkie środki pieniężne;

- w przypadku Serii Dochodowej oferującej Ekspozycje Lewarowane, gdzie Aktywami Referencyjnymi są Aktywa Fizyczne: Aktywa Referencyjne Strategii Inwestycyjnej dla takiej Serii Papierów Wartościowych ETP; Aktywa pomocnicze; i wszelkie środki pieniężne.

- w każdym przypadku utrzymywane na rachunku/rachunkach zabezpieczających ustanowionych dla tej Serii („Rachunek Zabezpieczający" i „Aktywa Zabezpieczające").

Kwoty pozostające na Rachunku Zabezpieczającego w odniesieniu do Serii Papierów Wartościowych ETP, w zakresie niewymaganym do inwestycji w celu odtworzenia wyników odpowiedniego Indeksu dla tych Serii lub do inwestycji zgodnie ze Strategią Inwestycyjną dla tych Serii, mogą na polecenie Administratora Portfela być utrzymywane jako salda gotówkowe na Rachunku Zabezpieczającego lub inwestowane w dług państwowy w walucie denominacji Papierów Wartościowych ETP o pierwotnym terminie zapadalności krótszym niż jeden miesiąc, który jest oceniany na poziomie co najmniej A-1 według Standard & Poor's Ratings Services i/lub P-1 przez Moody's Investors Service Ltd. i/lub F1 przez Fitch Ratings Limited („**Aktywa Pomocnicze**").

Tam, gdzie ma to zastosowanie, każda Seria Papierów Wartościowych ETP będzie odnosić się do wyników powiązanego Indeksu lub Strategii Inwestycyjnej w okresie dziennym, tygodniowym, miesięcznym lub innym okresie

określonym w Ostatecznych warunkach („**Okres Zrównoważenia**"). Na koniec każdego Okresu Zrównoważenia, Rachunek Zabezpieczający zostanie utworzony w celu śledzenia wyników Indeksu lub realizacji Strategii Inwestycyjnej.

Kwota wykupu Papierów Wartościowych ETP będzie pochodzić z likwidacji Aktywów Zabezpieczających, które zostały nabyte lub sprzedane zgodnie z Czynnikiem Dźwigni dla takiej Serii Papierów Wartościowych ETP.

W odniesieniu do każdej Serii Dochodowej Emitent dokona płatności kwot odsetek w odniesieniu do Papierów Wartościowych ETP tej Serii w odpowiednim terminie płatności odsetek określonym w Ostatecznych Warunkach.

Papiery Wartościowe ETP są swobodnie zbywalne.

Każda Seria Papierów Wartościowych ETP będzie uprawniać Posiadaczy Papierów Wartościowych ETP wyłącznie do udziału w przychodach z likwidacji proporcjonalnej części, w odniesieniu do tych Posiadaczy Papierów Wartościowych ETP, Aktywów Zabezpieczających znajdujących się na odpowiednim Rachunku Zabezpieczającym w odniesieniu do danej Serii, po proporcjonalnym potrąceniu wszystkich kosztów i wydatków poniesionych przez Emitenta w związku z likwidacją takich Aktywów Zabezpieczających, proporcjonalnym potrąceniu Opłaty za posrednictwo w złożeniu Oferty oraz wszelkich należnych odsetek od depozytów zabezpieczających, opłat za pożyczki papierów wartościowych i opłat maklerskich ("**Opłaty za Finansowanie i Opłaty Maklerskie"**) naliczonych od tych kwot oraz w przypadku Serii Dochodowej, wszelkie korekty proporcjonalne mają wziąć pod uwagę wszelkich kwot odsetek do zapłacenia w odniesieniu do Papierów Wartościowych ETP. Taka likwidacja będzie miała miejsce w Dniu Ostatecznego Wykupu (jak określono poniżej) lub tylko w ograniczonych okolicznościach przed tym terminem.

W określonych dniach wyceny Agent Ustalający będzie obliczać „**Wartość Papieru Wartościowego ETP**", która odzwierciedla wartość Aktywów Zabezpieczających w odniesieniu do Serii Papierów Wartościowych ETP skorygowaną w celu uwzględnienia wszystkich obowiązujących opłat i kosztów.

Dla każdej Serii Emitent ustanowi zabezpieczenie na Aktywach Zabezpieczających w odniesieniu do danej Serii na rzecz, między innymi, Posiadaczy Papierów Wartościowych ETP danej Serii. Po wyegzekwowaniu zabezpieczenia udzielonego przez Emitenta w odniesieniu do każdej Serii, Powiernik zastosuje wpływy uzyskane z realizacji Aktywów Zabezpieczających stanowiących przedmiot zabezpieczenia w odpowiedniej kolejności, zgodnie z którą kwoty należne Posiadaczom Papierów Wartościowych ETP będą podporządkowane wszystkim kosztom, opłatom, wydatkom i wszelkim innym kwotom, w tym (bez ograniczeń) kosztom egzekwowania i/lub realizacji wszelkich zabezpieczeń należnych samemu Powiernikowi i każdemu odbiornikowi, w każdym przypadku w odniesieniu do Posiadaczy Papierów Wartościowych ETP.

Jeżeli, w odniesieniu do Serii Papierów Wartościowych ETP, wpływy netto z realizacji zabezpieczenia ustanowionego w odniesieniu do takiej Serii przez Emitenta są niewystarczające do zapłaty wszystkich kwot należnych od Emitenta wobec zabezpieczonych wierzycieli (innych niż Dostawca(y) Pożyczki pod zastaw) w odniesieniu do tej Serii, żadne inne aktywa Emitenta nie będą dostępne w celu pokrycia niedoboru, a wszelkie zaległe roszczenia wierzycieli zabezpieczonych wygasną. Żadna strona (innych niż Dostawca(y) Pożyczki pod zastaw) nie będzie uprawniona do podjęcia dalszych kroków przeciwko Emitentowi w celu odzyskania jakiejkolwiek dalszej kwoty.

***Szczegółowe podsumowanie problemu:***

*Cel inwestycyjny: Realizować LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy, która ma na celu generowanie miesięcznego dochodu poprzez sprzedaż opcji na Super Micro Computer, Inc. oraz wypłatę zwrotu w oparciu o posiadane środki pieniężne. Strategia może również handlować opcjami w celach zabezpieczających.*

*Serie: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP*

*ISIN: XS3299465412*

*Liczba Papierów Wartościowych ETP: 15000*

*Papiery Wartościowe ETP emitowane zgodnie z niniejszymi Ostatecznymi Warunkami są denominowane w USD.*

*Termin Ostatecznego wykupu Papierów Wartościowych ETP przypada na dzień 19/03/2076 ("Dzień Ostatecznego Wykupu").Każdy Papier Wartościowy ETP ma Kwotę Główną wynoszącą USD 10.00.*

*Gdzie Papiery Wartościowe będą przedmiotem obrotu?*

***Szczegółowe podsumowanie problemu:***

Złożono wniosek do Urzędu ds. Postępowania Finansowego (Financial Conduct Authority („FCA") o dopuszczenie Papierów Wartościowych ETP, do których mają zastosowanie niniejsze Ostateczne Warunki, o dopuszczenie do Oficjalnej Listy FCA. Wniosek został złożony do Londyńskiej Giełdy Papierów Wartościowych o których zastosowanie mają niniejsze Ostateczne Warunki dopuszczenia do obrotu na Rynku Głównym Londyńskiej Giełdy Papierów Wartościowych.

Złożono wniosek do Giełdy Papierów Wartościowych we Euronext Amsterdam o dopuszczenie do notowań i obrotu na Rynku Regulowanym Giełdy Papierów Wartościowych we Euronext Amsterdam Serii Papierów Wartościowych ETP, której dotyczą niniejsze Ostateczne Warunki.

Do Giełdy Papierów Wartościowych we Frankfurcie (Frankfurter Wertpapierbörse) złożono wniosek o dopuszczenie serii Papierów Wartościowych ETP, do których mają zastosowanie niniejsze Warunki Ostateczne, do notowania i obrotu na giełdzie Deutsche Börse Xetra.

*Jakie są kluczowe ryzyka charakterystyczne dla Papierów Wartościowych?*

**INWESTYCJA W PAPIERY WARTOŚCIOWE ETP WIĄŻE SIĘ ZE ZNACZNYM STOPNIEM RYZYKA.** Poniżej przedstawiono kluczowe czynniki ryzyka, które potencjalni inwestorzy powinni dokładnie rozważyć przed podjęciem decyzji o zainwestowaniu w Papiery Wartościowe ETP. Inwestorzy powinni skonsultować się z własnymi doradcami finansowymi, prawnymi, księgowymi i podatkowymi w sprawie ryzyka związanego z inwestycją w Papiery Wartościowe ETP.

Cena rynkowa Papierów Wartościowych ETP: Papiery Wartościowe ETP mogą mieć długi termin wykupu, a Dzień Ostatecznego Wykupu może wynieść nawet 50 lat od pierwotnej Daty Emisji danej Serii. Jedynym sposobem, w jaki inwestor będzie mógł zrealizować wartość Papierów Wartościowych ETP przed Dniem Ostatecznego Wykupu, będzie ich sprzedaż po ówczesnej cenie rynkowej w ramach transakcji na rynku wtórnym.

Prowadzenie rynku przez Upoważnionych Uczestników: Inwestorzy są uzależnieni od tego, czy jeden lub więcej Upoważnionych Uczestników prowadzi działalność rynkową w odniesieniu do Papierów Wartościowych ETP w celu zapewnienia inwestorom płynności. Inwestorzy powinni mieć świadomość, że żaden Upoważniony Uczestnik nie jest zobowiązany do wprowadzania do obrotu jakiejkolwiek Serii Papierów Wartościowych ETP, a w sytuacji, gdy Upoważniony Uczestnik pełni funkcję animatora rynku w odniesieniu do jakiejkolwiek Serii Papierów Wartościowych ETP, taki Upoważniony Uczestnik może w dowolnym momencie zaprzestać wprowadzania do obrotu. Jeżeli nie ma Upoważnionych Uczestników lub Upoważniony(-i) Uczestnik(-cy) nie jest(są) w stanie skutecznie wprowadzać do obrotu Papierów Wartościowych ETP danej Serii, inwestorzy mogą nie być w stanie sprzedać Papierów Wartościowych ETP w krótkim czasie lub po cenie zbliżonej do Wartości Papierów Wartościowych ETP dla danej Serii. Jeżeli inwestorzy nie będą w stanie sprzedać Papierów Wartościowych ETP, nie będą w stanie zrealizować swojej inwestycji do dnia ostatecznego wykupu.

***Szczegółowe podsumowanie problemu:***

*Papiery Wartościowe ETP powiązane ze Strategią Inwestycyjną: Każdy Papier Wartościowy ETP będzie powiązany z wynikami Aktywów Referencyjnych, o których mowa w takiej Strategii Inwestycyjnej. Inwestorzy nie mają praw własności do żadnych Aktywów Referencyjnych Strategii Inwestycyjnej. Kwota płatna z tytułu wykupu Papierów Wartościowych ETP będzie zależeć od likwidacji Aktywów Zabezpieczających w odniesieniu do tej Serii.*

*Papiery wartościowe ETP powiązane z Kapitałowymi Papierami Wartościowymi: Ryzyko związane z Papierami wartościowymi ETP powiązanymi z Kapitałowymi Papierami Wartościowymi może obejmować między innymi możliwość znaczących zmian cen odpowiednich akcji. Wartość odpowiednich akcji może zarówno spadać, jak i rosnąć, a wartość odpowiednich akcji w dowolnym dniu może nie odzwierciedlać ich wyników w jakimkolwiek wcześniejszym okresie. Nie ma pewności co do przyszłej wartości papierów wartościowych lub dalszego istnienia jakiegokolwiek kapitału, długu lub spółki powiązanej. W związku z tym, przed podjęciem decyzji inwestycyjnej w odniesieniu do Papierów Wartościowych ETP potencjalni inwestorzy powinni dokładnie rozważyć, czy inwestycja, której zwrot będzie zależał od wyników kapitałowych papierów wartościowych, jest dla nich odpowiednia.*

*Aktywnie zarządzana strategia inwestycyjna: Posiadacze Papierów Wartościowych ETP nie mają prawa uczestniczyć w zarządzaniu Aktywami Zabezpieczającymi Serii Papierów Wartościowych ETP. Wszelkie decyzje dotyczące inwestowania wpływów z emisji Papierów Wartościowych ETP będą podejmowane zgodnie ze LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. Żadna osoba nie powinna nabywać Papierów Wartościowych ETP, chyba że jest gotowa powierzyć wszystkie aspekty zarządzania Aktywami Zabezpieczającymi Administratorowi Portfela w celu inwestowania zgodnie ze LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. Słabe wyniki LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy mogą negatywnie wpłynąć na wartość Papierów Wartościowych ETP, co może spowodować, że Posiadacze Papierów Wartościowych ETP otrzymują mniej lub znacznie mniej niż ich początkowa inwestycja.*

*Papiery wartościowe ETP powiązane z krótkimi pozycjami w opcjach sprzedaży: sprzedaż opcji sprzedaży naraża papiery wartościowe ETP na ryzyko, że cena aktywów bazowych opcji sprzedaży spadnie poniżej ceny wykonania w dniu wykonania. Emitent może wprowadzić opcje sprzedaży na zasadzie pokrycia, odkładając wystarczającą ilość gotówki, aby wywiązać się ze swoich zobowiązań wynikających z opcji sprzedaży. Jednakże Emitent może nie posiadać gotówki na pokrycie swojego narażenia wynikającego z opcji sprzedaży, co może spowodować stratę lub wcześniejsze rozwiązanie w zakresie, w jakim opcje sprzedaży są całkowicie lub częściowo niezabezpieczone. Dodatkowo, w zakresie, w jakim opcje sprzedaży są rozliczane fizycznie, Emitent może być od czasu do czasu zobowiązany do odbioru aktywów bazowych. W zakresie, w jakim jest właścicielem aktywów bazowych, Emitent*

*będzie narażony na ryzyko spadku ceny aktywów bazowych, co może skutkować spadkiem wartości papierów wartościowych ETP.*

## D Kluczowe Informacje o Publicznej Ofercie Papierów Wartościowych i/lub Dopuszczeniu do Obrotu na Rynku Regulowanym

*Na jakich warunkach i zgodnie z jakim harmonogramem mogę inwestować w ten papier wartościowy?*

Papiery Wartościowe ETP są udostępniane przez Emitenta do subskrypcji wyłącznie Upoważnionym Uczestnikom wyznaczonym przez Emitenta w związku z Programem, którzy złożyli Emitentowi ważne zamówienie subskrypcji. Nowe emisje Papierów Wartościowych ETP będą zazwyczaj rozliczane w drugim Dniu Roboczym w Londynie (dzień (inny niż sobota lub niedziela), w którym banki komercyjne i rynki walutowe rozliczają płatności w Londyn) następującym po dacie otrzymania przez Emitenta ważnego zamówienia subskrypcji na papiery wartościowe wraz z odpowiednią opłatą, pod warunkiem, że taki zapis zostanie złożony przed godziną 14.30 czasu londyńskiego w tym dniu.

W odniesieniu do każdej Serii Papierów Wartościowych ETP, opłaty należne od Posiadaczy Papierów Wartościowych ETP składają się z następujących elementów: (i) opłatę za pośrednictwo, która jest pobierana w wysokości 0.55% rocznie od Wartości Papierów Wartościowych ETP posiadanych przez Posiadacza Papierów Wartościowych ETP; (ii) odpowiednie Opłaty za Finansowanie i Opłaty Maklerskie, które podlegają korekcie; (iii) podatki, opłaty i inne kwoty należne Irlandzkim Komisarzom Skarbowym; (iv) kwoty należne Dostawcy Pożyczki pod zastaw oraz Zarejestrowanemu pośrednikowi maklerskiemu; oraz (v) koszty i wydatki poniesione w związku z likwidacją Aktywów Zabezpieczających.

Emitent przeniesie te koszty na inwestorów, zmniejszając tym samym wartość ich inwestycji w Papiery Wartościowe ETP. Emitent nie będzie obciążał inwestorów żadnymi innymi kosztami.

***Szczegółowe podsumowanie problemu:***

Oferta Papierów Wartościowych ETP, która nie objęta jest wyłączeniem z obowiązku opublikowania prospektu na mocy rozporządzenia (UE) 2017/1129 w trakcie odpowiedniego okresu oferty, może być dokonywana w Irlandii, Włoszech, Niemczech, Francji, Hiszpanii, Holandii, Polsce, Belgii, Szwecji, Norwegii oraz Austrii.

*Dlaczego sporządzany jest ten prospekt?*

Powodem oferty i wykorzystania wpływów jest osiągnięcie zysku i/lub hedging.

***Szczegółowe podsumowanie problemu:***

*Szacunkowa kwota netto wpływów z emisji wynosi 70688.72 USD.*

Emitent wykorzysta wpływy z emisji na finansowanie powiązanych Rachunków Zabezpieczających, które mogą być wymagane do utrzymania pozycji w Aktywach Referencyjnych w celu odtworzenia (w możliwym zakresie) zwrotu z Indeksu lub do realizacji Strategii Inwestycyjnej, o której mowa w Serii, z uwzględnieniem obowiązującego Współczynnika Dźwigni. Kwoty pozostające na koncie Rachunku Zabezpieczającego mogą również, według uznania Administratora Portfela, być utrzymywane jako salda gotówkowe na Rachunku Zabezpieczającym lub inwestowane w Aktywa Pomocnicze.

Oferta Papierów Wartościowych ETP nie jest przedmiotem umowy o subemisję na podstawie wiążącego zobowiązania.

*Istotne konflikty interesów*

Upoważnieni Uczestnicy i/lub ich odpowiednie podmioty stowarzyszone mogą prowadzić aktywną działalność handlową na niektórych rynkach. Taka działalność handlowa może powodować konflikt pomiędzy posiadaczami Papierów Wartościowych ETP a interesami, jakie Upoważnieni Uczestnicy i ich odpowiednie podmioty stowarzyszone mogą mieć na swoich rachunkach własnych, w ramach ułatwiania transakcji, w tym transakcji na opcjach i innych instrumentach pochodnych, dla swoich klientów oraz na rachunkach pozostających pod ich zarządem. Te działania handlowe, jeśli wpływają na wartość Indeksu lub Strategii Inwestycyjnej, z którą powiązana jest dana Seria Papierów Wartościowych ETP, mogą być sprzeczne z interesami Posiadaczy Papierów Wartościowych ETP.

Upoważnieni Uczestnicy i ich odpowiednie podmioty stowarzyszone mogą również emitować lub gwarantować dodatkowe papiery wartościowe lub handlować innymi produktami, z których zwrot jest powiązany z wartością Indeksu lub Strategii Inwestycyjnej powiązanej z Serią Papierów Wartościowych ETP lub innymi podobnymi strategiami. Zwiększony poziom inwestycji w te produkty może negatywnie wpłynąć na poziom Indeksu lub Strategii Inwestycyjnej, z którą powiązana jest Seria Papierów Wartościowych ETP, a tym samym na kwotę należną z tytułu takiej Serii Papierów Wartościowych ETP w określonym terminie ich zapadalności lub w jakimkolwiek wcześniejszym

dniu ostatecznego wykupu, w stosownych przypadkach, oraz wartość rynkową takich Papierów Wartościowych ETP.

GWM Limited (który może występować jako Broker Dealer of Record i/lub Uczestnik Uprawniony w odniesieniu do Serii Papierów Wartościowych ETP), Flexinvest Limited (który może występować jako Administrator Portfela), FlexAdvisor Limited (który może występować jako Administrator Portfela) oraz Agent ds. Ustaleń znajdują się pod wspólną własnością Jose Gonzaleza, który jest także dyrektorem oraz ostatecznym większościowym udziałowcem Aranżera. Gdy wskazane podmioty działają, mają wyłącznie obowiązki i odpowiedzialności wyraźnie przez nie uzgodnione w danej roli i nie będą, z samego faktu powiązania z podmiotem działającym w innej roli, uznawane za posiadające inne obowiązki lub odpowiedzialności ani zobowiązane do dochowania innego standardu należytej staranności niż wyraźnie przewidziany dla każdej z takich ról.

## BIJLAGE 1 – SPECIFIEKE SAMENVATTING

### A Inleiding en waarschuwingen

Deze samenvatting moet worden gelezen als een inleiding tot het basisprospectus van Leverage Shares plc zoals goedgekeurd door de Centrale Bank van Ireland (het " **Basisprospectus** " en "de **Emittent** "). Elke beslissing om te beleggen in de ETP Effecten (zoals hieronder gedefinieerd) moet worden gebaseerd op de overweging van het Basisprospectus als geheel door de belegger. **IN BEPAALDE OMSTANDIGHEDEN KAN DE BELEGGER HET BELEGDE KAPITAAL GEHEEL OF GEDEELTELIJK VERLIEZEN.** Wanneer een vordering met betrekking tot de informatie in het Basisprospectus voor een rechtbank wordt gebracht, kan het zijn dat de belegger als eiser, volgens de nationale wetgeving van de lidstaten, de kosten van de vertaling van het Basisprospectus moet dragen voordat de gerechtelijke procedure wordt gestart. Burgerlijke aansprakelijkheid is alleen van toepassing op die personen die de samenvatting hebben ingediend, inclusief enige vertaling daarvan, alleen als de samenvatting misleidend, incorrect of inconsistent is wanneer ze samen met de andere delen van het Basisprospectus wordt gelezen, of als deze enige informatie niet bevat. Wanneer ze samen met de andere delen van het Basisprospectus, essentiële informatie geven om beleggers te helpen, bij het overwegen om in de ETP Effecten te beleggen.

*Uitgever:* Leverage Shares Plc, 2 nd Floor, Block 5, Irish Life Centre, Abbey Street Lower, Dublin 1, D01 P767, Ierland.
Website: https://leverageshares. com
Telefoon: +353 1 2240300
LEI: 635400TLFJSNHVSOFH59

*Bevoegde autoriteit:* Central Bank of Ireland, New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, Ierland
Website: https://centralbank.ie
Telefoon: + 353 (0) 1 224 6000

*Datum van goedkeuring van het Basisprospectus:* 11/06/2026. Suplementos: 07/07/2026

***Specifieke samenvatting:***

*Effecten: Series: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP, ISIN: XS3299465412*

### B Essentiële informatie over de Emittent

*Wie is de Emittent van de Effecten?*

De Emittent is Leverage Shares PLC, een naamloze vennootschap gevestigd in Ierland en opgericht onder de Companies Act 2014 van Ierland met geregistreerd nummer 597399. De Emittent opereert volgens de wetten van Ierland. Het LEI-nummer van de Emittent is 635400TLFJSNHVSOFH59.

De beschreven hoofdactiviteit van de Emittent is de uitgifte van en de uitvoering van zijn verplichtingen uit hoofde van door onderpand op de beurs verhandelde effecten (de " **ETP Effecten** "). De Emittent heeft een programma opgesteld (het " **Programma** "), beschreven in het Basisprospectus, op grond waarvan van tijd tot tijd series ETP Effecten (elk een " **Serie** ") kunnen worden uitgegeven.

Alle uitgegeven aandelen van de Emittent zijn direct of indirect in het bezit van Monument Trustees Limited, met maatschappelijke zetel te 57 Herbert Lane, Dublin 2, Ierland en geregistreerd onder nummer 345558 (de " **Share Trustee** ") onder de voorwaarden van een trustverklaring gedateerd 20 juni 2017 op grond waarvan de Share Trustee het voordeel van de aandelen in trust houdt voor charitatieve doeleinden. De Emittent is noch direct, noch indirect eigendom van of wordt gecontroleerd door enige andere partij bij het Programma.

De bestuurders van de Emittent zijn Neil Fleming en Ciarán Connolly.

De accountants van de Emittent zijn Grant Thornton, 18 City Quay, Dublin 2, Ierland, registeraccountants die gekwalificeerd zijn om in Ierland te werken en leden van het Institute of Chartered Accountants in Ierland.

***Specifieke samenvatting:***

*De Emittent heeft de volgende dienstverleners aangesteld met betrekking tot de ETP Effecten:*

- *Apex Corporate Trustees (UK) Limited zal optreden als trustee (de "**Trustee**");*

- *Flexinvest Limited zal optreden als portfoliobeheerder (de "**Portfoliobeheerder**");*
- *Interactive Brokers LLC en/of Morgan Stanley & Co. LLC en/of Pershing LLC zal handelen als aanbieder van marge leningen (de aanbieder van de "**Marge lening(en)**");*
- *Leverage Shares Management Company Limited zal optreden als arrangeur;*
- *U.S. Bank Europe DAC zal optreden als uitgifte- en betaalagent;*
- *U.S. Bank Europe DAC zal optreden als registrar;*
- *Calculation Agent Services LLC zal optreden als bepalingsagent;*
- *GWM Limited zal optreden als de geregistreerde makelaar; en*
- *De geautoriseerde deelnemers staan vermeld op de website van de emittent.*

*Wat is de belangrijkste financiële informatie over de Emittent?*

**Overzicht van het totaalresultaat van Leverage Shares plc voor de financiële periode**

| | 1-juli-24 tot 30-jun-2025 USD - Gecontroleerd | 1-juli-23 tot 30-jun-2024 USD - Gecontroleerd |
|---|---|---|
| Nettowinst (verlies) | - 53,223 | 4,935 |

**Overzicht van de financiële positie van Leverage Shares plc voor de afgesloten financiële periode**

| | 30-Jun-2025 USD - Gecontroleerd | 30-Jun-2024 USD- Gecontroleerd |
|---|---|---|
| Totale activa | 3,586,373,432 | 2,046,580,088 |
| Totale verplichtingen | 3,586,439,659 | 2,046,593,092 |
| Financiële activa tegen reële waarde via winst of verlies | 3,367,625,495 | 1,935,575,783 |
| Afgeleide financiële activa | 0 | 0 |
| Financiële verplichtingen tegen reële waarde via winst of verlies | 1,368,044,139 | 790,712,170 |
| Afgeleide financiële verplichtingen | 0 | 0 |

*Wat zijn de belangrijkste risico's die specifiek zijn voor de Emittent?*

**De Emittent is een voertuig voor speciale doeleinden:** De Emittent is een voertuig voor speciale doeleinden met als enige taak het uitgeven van ETP Effecten.

De enige middelen van de Emittent om betalingen te doen met betrekking tot een Serie ETP Effecten zijn de bedragen die de Emittent ontvangt uit de realisatie van de Onderpand activa (zoals hieronder gedefinieerd). Voor elke Serie zal de Emittent zekerheid creëren over de Onderpand activa met betrekking tot die Serie ten gunste van, onder andere, de ETP Effectenhouders van die Serie. In het geval dat de door de Emittent gecreëerde zekerheid wordt afgedwongen, en de opbrengst van een dergelijke uitwinning, na betaling aan alle senior crediteuren, onvoldoende is om alle bedragen die verschuldigd zijn aan dergelijke houders van ETP Effecten volledig te betalen, is de Emittent niet aansprakelijk, verplichting of schuld voor een betalingsachterstand en geen van de ETP Effectenhouders of de Trustee (of enige andere partij die namens hen handelt) mag enige verdere actie ondernemen om dergelijke bedragen terug te vorderen.

**Claims van de aanbieder van marge leningen:** beleggers dienen zich ervan bewust te zijn dat de overeenkomsten aangaat tussen de Emittent en de aanbieder van de Marge lening (de **"marge rekening overeenkomst"**) die bevat geen beperkte bepalingen met betrekking tot de verplichtingen van de Emittent. Er bestaat daarom een risico dat, met betrekking tot een claim tegen de Emittent door: een aanbieder van marge leningen, met betrekking tot een marge rekening overeenkomst. Indien na realisatie in vol van het Gedekte Eigendom (hetzij door middel van vereffening of tenuitvoerlegging) met betrekking tot een reeks van ETP Effecten en toepassing van beschikbare contanten in overeenstemming met de toepasselijke rangorden van prioriteit en de trustakte, blijft er een vordering openstaan tegen de uitgevende instelling, een dergelijke vordering op pro rata basis worden ingediend op activa die

toe te schrijven zijn aan andere uitstaande reeksen van ETP Effecten. GWM Limited, die kan optreden als de geregistreerde broker-dealer met betrekking tot bepaalde Series van ETP Effecten (de " **Broker Dealer of Record** "), heeft er echter mee ingestemd de Emittent te vrijwaren van enig verlies, kosten, claim, actie, eis of uitgave die de Emittent kan oplopen als gevolg van dergelijke vorderingen door de Marge lening aanbieder.

**C Belangrijke informatie over de effecten**

*Wat zijn de voornaamste kenmerken van de Effecten?*

Elke Serie van ETP Effecten zal ofwel gekoppeld zijn aan een index (de " **Index** ") of zal een beleggingsstrategie nastreven die de manier beschrijft waarop de opbrengsten van de uitgifte van de ETP Effecten zullen worden belegd, samen met eventuele hefboomwerking die moet worden gebruikt met betrekking tot een dergelijke beleggingsstrategie (de " **Beleggingsstrategie** "). De Index of Beleggingsstrategie zal verwijzen naar een of meer activa (de " **Referentie-activa** ") die kunnen bestaan uit (i) aandelen, (ii) schuldeffecten, (iii) vastrentende effecten, (iv) deelbewijzen in op de beurs verhandelde fondsen; (v) beleggingsfondsen ( items (i) tot (v), (" **Fysieke activa** ") of (vi) futures-contracten en (vii) optiecontracten.

Series van ETP Effecten kan lange postities met hefboomwerking bieden ( "**Hefboom blootstelling**"), korte omgekeerde met hefboomwerking posities ("**Short Blootstelling**") of + 1x blootstelling ( " **Normale Blootstelling**") voor de Reference Assets. Met betrekking tot Series van ETP Effecten die Hefboomblootstellingen en Shortblootstellingen aanbieden, zal de mate van hefboomwerking of omgekeerde hefboomwerking worden ingebed in (i) de Index of Beleggingsstrategie; of (ii) rechtstreeks in de ETP Effecten. De mate van hefboomwerking die van toepassing zal zijn op elke Serie van ETP Effecten zal worden weerspiegeld in de toepasselijke hefboomfactor (de " **Hefboomfactor"** ). Er kunnen ook series van ETP-effecten worden uitgegeven, die tot doel hebben inkomsten te genereren ter financiering van periodieke rente (de "Income Series"). De beleggingsstrategie van een Income Series kan ook worden voorzien van een: Hefboomblootstelling aan de relevante referentieactiva, waarvan de details in de beschrijving zullen worden opgenomen van de Investeringsstrategie.

De onderpandactiva met betrekking tot elke Serie van ETP-effecten zijn:

- in het geval van blootstellingen met hefboomwerking en normale blootstellingen waarbij de referentie-activa fysieke activa zijn: de referentie-activa van de toepasselijke index of beleggingsstrategie voor dergelijke series van ETP Effecten; Aanvullende activa (zoals hieronder gedefinieerd); en eventueel contant geld;

- in het geval van shortblootstellingen waarbij de referentieactiva fysieke activa zijn: de mark-to-market-waarde van effectenleningen; de Aanvullende Activa; en eventueel contant geld;

- in het geval dat bij ETP Effecten, Referentie-activa futurescontracten zijn: de mark-to-market-waarde van de futurescontracten; de Aanvullende Activa; en eventueel contant geld,

- in het geval waar de Income Series de referentieactiva optiecontracten zijn: dan zal de mark-to-market-waarde van de optiecontracten; eventuele onderliggende activa van de optiecontracten die zijn verworven door de Emittent om (i) zijn blootstelling onder de opties te dekken in overeenstemming met de Beleggingsstrategie of (ii) als gevolg van de fysieke afwikkeling van de optiecontracten; Bijkomende activa; en eventueel contant geld;

- In het geval dat een Income Series die blootstellingen aanbieden waarbij de referentieactiva fysieke activa zijn: zullen de referentieactiva van de beleggingsstrategie voor dergelijke series van ETP effecten; Bijkomende activa; en eventueel contant geld zijn.

in elk geval zoals aangehouden op de margerekening(en) die voor die Serie zijn opgericht (de " **Margerekening** " en de " **Onderpand activa** ").

Bedragen die ten gunste van een Marginrekening staan met betrekking tot een Serie ETP Effecten, voor zover niet vereist voor beleggingen, om de prestatie van de relevante Index voor die Serie te repliceren of voor beleggingen in overeenstemming met de Beleggingsstrategie voor die Serie, kunnen op aanwijzing van de Portefeuillebeheerder worden aangehouden als kassaldo's op de Margerekening of worden belegd in overheidsschuld in de valuta waarin de ETP Effecten luiden met een oorspronkelijke looptijd van minder dan één maand en die een rating heeft van ten minste A-1, volgens Standard & Poor's Ratings Services, en/of P-1 door Moody's Investors Service Ltd. en/of F1 door Fitch Ratings Limited (de " **Aanvullende Activa** ").

Waar van toepassing, zal elke Serie van de ETP Effecten zal verwijzen naar de prestaties van de gerelateerde Index van de Beleggingsstrategie over een dagelijkse, wekelijkse, maandelijkse periode of een andere periode zoals uiteengezet in de Definitieve Voorwaarden (de " **Herbalancerings periode** "). Aan het einde van elke herbalancerings periode wordt de margerekening opnieuw samengesteld om de prestaties van de index te volgen of de beleggingsstrategie na te streven.

Het aflossingsbedrag van de ETP Effecten zal worden afgeleid van de vereffening van de Onderpandactiva, zoals gekocht of verkocht in overeenstemming met de Hefboomfactor van een dergelijke Serie van ETP Effecten.

Met betrekking tot elke Income Series, zal de Emittent rentebetalingen doen met betrekking tot de ETP Effecten van die Serie op de relevante rente betalingsdatum. Zoals uiteengezet in de Definitieve Voorwaarden.

De ETP Effecten zijn vrij overdraagbaar.

Elke Serie van ETP Effecten zal alleen rechten geven aan ETP Effectenhouders om deel te nemen in de opbrengst van de liquidatie van een *pro rata* deel, met betrekking tot dergelijke ETP Effectenhouders, van de Onderpand activa aangehouden op de relevante Marginrekening met betrekking tot de dergelijke Serie, na de pro rata aftrek van alle kosten en uitgaven gemaakt door de Emittent in verband met de vereffening van dergelijke Onderpandactiva, de *pro rata* aftrek van de Arrangeurvergoeding en eventuele toepasselijke margerente, vergoedingen voor effectenleningen en makelaarskosten (" **Financierings- en Makelaarskosten** " ) daarop opgebouwd en in het geval waar de Inkomsten Serie, pro rata aanpassingen doet om rekening te houden met eventuele rentebedragen die moeten worden betaald met betrekking tot de ETP-effecten. Een dergelijke liquidatie zal plaatsvinden op de Definitieve Aflossingsdatum (zoals hieronder gespecificeerd) of slechts in beperkte omstandigheden vóór deze datum.

Op gespecificeerde waarderingsdagen wordt door de Bepalingsagent een " **ETP-Effectwaarde** " berekend die de waarde van de Onderpand activa met betrekking tot een Serie ETP Effecten zal weerspiegelen, zoals aangepast om rekening te houden met alle toepasselijke vergoedingen en kosten.

Voor elke Serie zal de Emittent zekerheid creëren over de Onderpand activa met betrekking tot die Serie ten gunste van, onder andere, de ETP Effectenhouders van die Serie. Na de executie van de zekerheid die door de Emittent is verleend met betrekking tot elke Serie, zal de Trustee de opbrengsten die zijn verkregen uit de realisatie van de Onderpand activa die het onderwerp zijn van de zekerheid toepassen in de toepasselijke volgorde van prioriteit waaronder de bedragen die verschuldigd zijn aan de ETP Effectenhouders zijn achtergesteld bij alle kosten, vergoedingen, uitgaven en alle andere bedragen, inclusief (maar niet beperkt tot) de kosten van het afdwingen en/of realiseren van enige zekerheid die verschuldigd is aan de Trustee zelf en een eventuele ontvanger, in elk geval met betrekking tot de ETP Effectenhouders.

Indien, met betrekking tot een Serie ETP Effecten, de netto-opbrengst van de realisatie van de zekerheid gecreëerd met betrekking tot dergelijke Serie door de Emittent onvoldoende is om alle bedragen te betalen die de Emittent verschuldigd is aan de gedekte schuldeisers (anders dan de aanbieder van de Marge lening(en)) met betrekking tot die Serie, zullen geen andere activa van de Emittent beschikbaar zijn om enig tekort te dekken en zullen alle uitstaande vorderingen van dergelijke gedekte schuldeisers teniet worden gedaan. Geen enkele partij (anders dan de aanbieder van de Marge lening(en)) zal het recht hebben om verdere stappen te ondernemen tegen de Emittent om een verder bedrag terug te vorderen.

***Specifieke samenvatting:***

*Beleggingsdoelstelling: De LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy na te streven, die beoogt maandelijks inkomsten te genereren door opties op Super Micro Computer, Inc. te verkopen en een rendement te betalen op basis van de aangehouden kasmiddelen. De strategie kan ook opties verhandelen voor afdekkingsdoeleinden.*

*Serie: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP*

*ISIN: XS3299465412*

*Aantal ETP Effecten: 15000*

*De ETP Effecten uitgegeven ingevolge deze Definitieve Voorwaarden worden uitgedrukt in USD.*

*De eindvervaldatum van de ETP Effecten is 19/03/2076 (de " Definitieve Aflossingsdatum ").Elke ETP-beveiliging heeft een hoofdbedrag van USD 10.00.*

*Waar zullen de Effecten worden verhandeld?*

***Specifieke samenvatting:***

*Er is een aanvraag ingediend bij de Financial Conduct Authority ("FCA") om de ETP Effecten waarop deze Definitieve Voorwaarden van toepassing zijn, te laten opnemen in de Officiële Lijst van de FCA. Er is een aanvraag ingediend bij de London Stock Exchange voor de ETP Effecten waarop deze Definitieve Voorwaarden van toepassing zijn om te worden toegelaten tot de handel op de Main Market van de London Stock Exchange.*

*Er is een aanvraag ingediend bij de Euronext Amsterdam Stock Exchange voor de serie ETP Effecten waarop deze definitieve voorwaarden van toepassing zijn om te worden toegelaten tot de notering en handel op de gereglementeerde markt van de Euronext Amsterdam Stock Exchange.*

*Er is een aanvraag ingediend bij de effectenbeurs van Frankfurt (Frankfurter Wertpapierbörse) voor de Serie ETP Securities, waarop deze Definitieve Voorwaarden van toepassing zijn, om te worden toegelaten voor een beursnotering en handel op de Deutsche Börse Xetra.*

*Wat zijn de belangrijkste risico's die specifiek zijn voor de Effecten?*

**EEN BELEGGING IN ETP EFFECTEN BRENGT EEN AANZIENLIJK RISICO MET ZICH MEE.** Hieronder volgen de belangrijkste risicofactoren waarmee potentiële beleggers zorgvuldig rekening moeten houden voordat ze beslissen of ze in de ETP Effecten willen beleggen. Beleggers dienen hun eigen financiële, juridische, boekhoudkundige en belastingadviseurs te raadplegen over de risico's van een belegging in ETP Effecten.

Marktprijs van de ETP Effecten: De ETP Effecten kunnen een lange looptijd hebben en de definitieve aflossingsdatum kan tot 50 jaar vanaf de oorspronkelijke uitgiftedatum van de serie liggen. De enige manier waarop een belegger in staat zal zijn om waarde te realiseren van een ETP-effect vóór de definitieve aflossingsdatum, is door het te verkopen tegen de dan geldende marktprijs in een secundaire markttransactie.

Marktvorming door geautoriseerde deelnemers: Beleggers zijn afhankelijk van de aanwezigheid van een of meer geautoriseerde deelnemers die een markt in ETP Effecten aangaan, om beleggers van liquiditeit te voorzien. Beleggers dienen zich ervan bewust te zijn dat geen enkele geautoriseerde deelnemer verplicht is om een markt te openen voor een serie ETP Effecten en in omstandigheden waarin een geautoriseerde deelnemer een market maker is met betrekking tot een serie ETP Effecten, kan een dergelijke geautoriseerde deelnemer stoppen met het maken van een markt op elk gewenst moment. Als er geen geautoriseerde deelnemers zijn, of de geautoriseerde deelnemer(s) er niet in slagen om effectief een markt te creëren in de ETP Effecten van een serie, zijn de beleggers mogelijk niet in staat om dergelijke ETP Effecten binnen een korte tijdsperiode of tegen een prijs te verkopen dicht bij de ETP-beveiligingswaarde voor die serie. Als beleggers de ETP Effecten niet kunnen verkopen, kunnen ze hun belegging pas op de uiterste terugkoopdatum realiseren.

***Specifieke samenvatting***

*ETP Effecten gekoppeld aan een beleggingsstrategie: elk ETP Effect zal worden gekoppeld aan de prestaties van de referentieactiva waarnaar wordt verwezen door een dergelijke beleggingsstrategie. Beleggers hebben geen eigendomsrechten op referentieactiva van een beleggingsstrategie. Het te betalen bedrag bij aflossing van de ETP Effecten hangt af van de vereffening van de Onderpandactiva met betrekking tot die Serie.*

*ETP-effecten gekoppeld aan Aandeleneffecten: De risico's van een ETP-effect gekoppeld aan aandeleneffecten omvatten, maar zijn niet beperkt tot, de mogelijkheid van significante veranderingen in de prijs (prijzen) van de relevante aandelen. De waarde van de relevante aandelen kan zowel dalen als stijgen en de waarde van relevante aandelen op een bepaalde datum weerspiegelt mogelijk niet hun prestaties in een voorgaande periode. Er kan geen zekerheid worden gegeven met betrekking tot de toekomstige waarde van aandelen of van het voortbestaan van de aandelen, schulden of de daarmee verbonden onderneming. Dienovereenkomstig dienen potentiële beleggers, alvorens een investeringsbeslissing te nemen met betrekking tot ETP-effecten, zorgvuldig te overwegen of een belegging, waarvan het rendement zal afhangen van de prestaties van aandelen, geschikt voor hen is.*

*Actief beheerde beleggingsstrategie: Houders van ETP Securities hebben niet het recht om deel te nemen aan het beheer van de Onderpand activa van de ETP Securities. Alle beslissingen met betrekking tot de belegging van de ETP Securities zullen worden genomen in overeenstemming met de LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. Niemand mag ETP Securities kopen, tenzij hij bereid is alle aspecten van het beheer van de Onderpand activa toe te vertrouwen aan de Portefeuillebeheerder, om te beleggen in overeenstemming met de LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy. Slechte prestaties van de LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy kunnen een negatieve invloed hebben op de waarde van de ETP Securities, wat ertoe kan leiden dat de houders van ETP Securities minder of aanzienlijk minder ontvangen dan hun initiële belegging.*

*ETP effecten gekoppeld aan shortposities in putopties: het verkopen van putopties stelt de ETP effecten bloot aan het risico dat de prijs van de onderliggende activa van de putoptie op de uitoefendatum onder de uitoefenprijs daalt. De emittent kan de putopties op een gedekte basis aangaan door voldoende contanten opzij te zetten om aan zijn verplichtingen onder de putopties te voldoen. De emittent mag echter geen contanten aanhouden om zijn blootstelling onder de putopties te dekken, wat kan leiden tot een verlies of vervroegde afwikkeling in de mate waarin de putopties geheel of gedeeltelijk ongedekt zijn. Bovendien kan de emittent, in de mate waarin de putopties fysiek worden afgewikkeld, van tijd tot tijd worden verplicht om de onderliggende activa in ontvangst te nemen. In de mate dat de emittent de onderliggende activa bezit, wordt de emittent blootgesteld aan het risico dat de prijs van de onderliggende activa daalt, wat kan resulteren in een daling van de ETP effectenwaarde.*

**D Essentiële informatie over het aanbod van Effecten aan het publiek en/of de toelating tot handel op een gereglementeerde markt**

*Onder welke voorwaarden en welk tijdschema kan ik investeren in de ETP Effecten?*

De ETP Effecten worden door de Emittent alleen beschikbaar gesteld voor inschrijving aan Geautoriseerde deelnemers die door de Emittent zijn aangesteld met betrekking tot het Programma en die een geldige inschrijvingsopdracht hebben ingediend bij de Emittent. Nieuwe uitgiften van ETP Effecten worden over het algemeen afgewikkeld op de tweede Londense Werkdag (een dag (anders dan een zaterdag of zondag) waarop commerciële banken en valutamarkten betalingen in Londen afwikkelen) volgend op de datum waarop een geldige inschrijvingsopdracht is ontvangen door de Emittent, samen met de toepasselijke vergoeding, op voorwaarde dat een dergelijke bestelling op die dag vóór 14.30 uur Londense tijd is ontvangen.

Met betrekking tot elke serie van ETP-Effecten omvatten de kosten die door de houders van ETP-Effecten moeten worden betaald de volgende componenten: (i) een arrangeurvergoeding die wordt geheven tegen een tarief van 0.55% per jaar van de waarde van de ETP-Effecten die door een ETP-Effectenhouder worden gehouden; (ii) de relevante financierings- en makelaarskosten die aanpassing kunnen ondergaan; (iii) belastingen, kosten en andere bedragen die aan de Ierse belastingautoriteiten moeten worden betaald; (iv) bedragen die aan de marginleningverstrekker en de geregistreerde makelaar moeten worden betaald; en (v) de kosten en uitgaven die verband houden met de liquidatie van de onderliggende activa.

De Emittent zal deze kosten doorberekenen aan beleggers, waardoor de waarde van hun belegging in de ETP Effecten wordt verlaagd. De Emittent zal geen andere kosten aanrekenen aan beleggers.

***Specifieke samenvatting:***

Een aanbod van ETP-effecten dat niet onder een ontheffing valt van de verplichting om een prospectus te publiceren overeenkomstig Verordening (EU) 2017/1129 tijdens de desbetreffende aanbiedingsperiode, kan worden gedaan in Ierland, Italië, Duitsland, Frankrijk, Spanje, Nederland, Polen, België, Zweden, Noorwegen en Oostenrijk.

*Waarom wordt dit prospectus opgesteld?*

De redenen voor het aanbieden en aanwenden van opbrengsten zijn het maken van winst en/of hedging.

***Specifieke samenvatting:***

*Het geschatte nettobedrag van de opbrengst van de uitgifte is USD 70688.72.*

De Emittent zal de opbrengst van de uitgifte gebruiken om de gerelateerde Margerekeningen te financieren die nodig kunnen zijn om posities in de Referentie-activa te behouden om (voor zover mogelijk) het rendement van de Index te repliceren of om de Beleggingsstrategie na te streven waarnaar in de Serie wordt verwezen rekening houdend met de toepasselijke Hefboomfactor. Bedragen die op de Margerekening staan, kunnen, naar goeddunken van de Portefeuillebeheerder, ook worden aangehouden als kassaldo's op de Margerekening of worden belegd in Aanvullende Activa.

Het aanbod van ETP Effecten is niet onderworpen aan een onderschrijvings overeenkomst op basis van een vaste verbintenis.

*Materiële belangenverstrengeling*

De Geautoriseerde Deelnemers en/of hun respectievelijke filialen kunnen actieve handelaren zijn in bepaalde markten. Deze handelsactiviteiten kunnen een conflict opleveren tussen de houders van de ETP Effecten en de belangen die de geautoriseerde deelnemers en hun respectievelijke gelieerde ondernemingen kunnen hebben in hun eigen rekeningen, bij het faciliteren van transacties, inclusief opties en andere derivaten transacties, voor hun klanten en in rekeningen onder hun beheer. Deze handelsactiviteiten kunnen, als ze de waarde van een Index of Beleggingsstrategie waaraan een Reeks ETP Effecten is gekoppeld, beïnvloeden, of nadelig zijn voor de belangen van de ETP Effectenhouders. De geautoriseerde deelnemers en hun respectievelijke geassocieerde ondernemingen kunnen ook aanvullende effecten uitgeven of verzekeren, of andere producten verhandelen waarvan het rendement is gekoppeld aan de waarde van een index of beleggingsstrategie die is gekoppeld aan een serie ETP Effecten of andere vergelijkbare strategieën. Een hoger niveau van belegging in deze producten kan een negatief effect hebben op het niveau van een Index of Beleggingsstrategie waaraan een Serie ETP Effecten is gekoppeld en dus het te betalen bedrag met betrekking tot de dergelijke Serie ETP Effecten, op hun vermelde vervaldatum of enige voorafgaande aflossing datum, indien van toepassing, en de marktwaarde van dergelijke ETP Effecten.

GWM Limited (die kan optreden als Broker Dealer of Record en/of Geautoriseerde Deelnemer met betrekking tot een Serie ETP-effecten), Flexinvest Limited (die kan optreden als Portefeuillebeheerder), FlexAdvisor Limited (die kan optreden als Portefeuillebeheerder) en de Vaststellingsagent staan onder het gezamenlijke eigendom van Jose Gonzalez, die tevens directeur en uiteindelijke meerderheidsaandeelhouder van de Arranger is. Wanneer dergelijke entiteiten handelen, hebben zij uitsluitend de taken en verantwoordelijkheden die uitdrukkelijk met hen in de betreffende hoedanigheid zijn overeengekomen en zullen zij niet, louter vanwege de relatie met een entiteit die in

een andere hoedanigheid optreedt, geacht worden andere taken of verantwoordelijkheden te hebben of een andere zorgplicht te hanteren dan uitdrukkelijk voor die betreffende hoedanigheid is voorzien.

**BILAGA 1 – PROBLEMSPECIFIK SAMMANFATTNING**

## A Inledning och varningar

Denna sammanfattning ska läsas som en inledning till grundprospektet för L S Limited som godkänts av Finansinspektionen (”***Grundprospektet***” och ”**Utfärdaren**”). Varje beslut att investera i de börshandlade värdepapperna (enligt definitionen nedan) bör baseras på att investeraren tar hänsyn till *grundprospektet* i sin helhet. **EN INVESTERARE KAN FÖRLORA VÄRDET PÅ HELA SIN INVESTERING ELLER DEL AV DEN**. Om ett krav avseende informationen i grundprospektet ställs inför en domstol, kan den kärande investeraren, enligt medlemsstaternas nationella lagstiftning, behöva stå för kostnaderna för att översätta grundprospektet innan det rättsliga förfarandet inleds. Civilrättsligt ansvar gäller endast de personer som har lagt fram sammanfattningen inklusive översättning av den, men endast om sammanfattningen är vilseledande, felaktig eller inkonsekvent när den läses tillsammans med de andra delarna av grundprospektet eller den inte tillhandahåller, när den läses tillsammans med de andra delarna av grundprospektet, nyckelinformation för att hjälpa investerare när de överväger om de ska investera i de börshandlade värdepapperna.

*Utfärdare:* Leverage Shares Plc, 2nd Floor, Block 5, Irish Life Centre, Abbey Street Lower, Dublin 1, D01 P767, Ireland.
*Webbplats*: https://leverageshares.com
Telephone: +353 12240300
LEI: 635400TLFJSNHVSOFH59

*Behörig myndighet:* Irlands centralbank, New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, Ireland
Website: https://centralbank.ie
Telephone: + 353 (0) 1 224 6000

*Datum för godkännande av grundprospektet:* 11/06/2026. Tillägg: 07/07/2026

***Beskrivande sammanfattning**:*

*Värdepapper: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP, ISIN: XS3299465412*

## B Nyckelinformation om utfärdaren

*Vem är utfärdaren av värdepapperen*?

Utfärdaren är Leverage Shares PLC, ett publikt aktiebolag med hemvist i Irland och inkorporerat under den irländska aktiebolagslagen 2014 med registrerat nummer 597399. Utfärdaren verkar enligt Irlands lagar. Utfärdarens LEI-nummer är 635400TLFJSNHVSOFH59.

Utfärdarens beskrivna huvudsakliga verksamhet är utfärdandet av och fullgörandet av dess förpliktelser under säkerheter mot börshandlade värdepapper ("**Börshandlade värdepapper**"). Utfärdaren har upprättat ett program ("**Programme**t"), som beskrivs i Grundprospektet, enligt vilket serier av börshandlade värdepappenar (var och en "**Serie**") kan emitteras från tid till annan.

All the issued shares of the Issuer are directly or indirectly held by Monument Trustees Limited, with its registered office at 57 Herbert Lane, Dublin 2, Ireland and registered number 345558 (the “**Share Trustee**”) under the terms of a declaration of trust dated 20 June 2017 pursuant to which the Share Trustee holds the benefit of the shares on trust for charitable purposes. The Issuer is neither directly nor indirectly owned or controlled by any other party to the Programme.
Utfärdarens samtliga aktier ägs direkt eller indirekt av Monument Trustees Limited, med sitt registrerade kontor på 57 Herbert Lane, Dublin 2, Irland och registrerat nummer 345558 (”**Aktieförvaltaren**”) enligt villkoren i en deklaration från den 20 juni 2017 och förvaltaren innehar förmånen av aktierna på förtroende för välgörande ändamål. Utfärdaren ägs eller kontrolleras varken direkt eller indirekt av någon annan part i Programmet.
Utfärdarens styrelseledamöter är Neil Fleming and Ciarán Connolly.
Utfärdarens revisorer är Grant Thornton, 18 City Quay, Dublin 2, Irland, som är auktoriserade revisorer som är kvalificerade att praktisera i Irland och medlemmar av Institutet för auktoriserade revisorer i Irland.

***Problemspecifik sammanfattning:***

*Utfärdaren har utsett följande tjänsteleverantörer med avseende på de börshandlade värdepapper:*

- *Apex Corporate Trustees (UK) Limited kommer att agera som förvaltare (”**Förvaltaren**”);*

- *Flexinvest Limited kommer att agera som portföljförvaltare (”**Portföljförvaltaren**”);*
- *Interactive Brokers LLC and/or Morgan Stanley & Co. LLC and/or Pershing LLC* kommer att agera
- som leverantör av marginallån (”**Leverantören av marginallån**”);
- *Leverage Shares Management Company Limited kommer att agera som arrangör;*
- *U.S. Bank Agency Agreement kommer att agera som utfärdande och betalningsombud;*
- *U.S. Bank Europe DAC kommer att fungera som registrator;*
- *Calculation Agent Services LLC kommer att agera som beslutsombud;*
- *GWM Limited kommer att agera som utsedd mäklarfirma (broker-dealer of record);*
- *De auktoriserade deltagarna är listade på Emittentens webbplats.*

*BNP Paribas Arbitrage S.N.C., Virtu Financial Ireland Limited är den auktoriserade deltagaren.*

*Vilken är den viktigaste finansiella informationen om utfärdaren?*

**Rapport över totalresultat för Leverage Shares plc för räkenskapsperioden**

| | 1-Jul-24<br>Till<br>30-Jun-2025<br>USD - Reviderad | 1-Jul-23<br>Till<br>30-Jun-2024<br>USD - Reviderad |
|---|---|---|
| Nettovinst/(förlust) | - 53,223 | 4,935 |

**Rapport över finansiell ställning för Leverage Shares plc för räkenskapsperioden som avslutades**

| | 30-Jun-2025<br>USD - Audited | 30-Jun-2024<br>USD - Audited |
|---|---|---|
| Totala tillgångar | 3,586,373,432 | 2,046,580,088 |
| Totala skulder | 3,586,439,659 | 2,046,593,092 |
| Finansiella tillgångar värderade till verkligt värde via resultaträkningen | 3,367,625,495 | 1,935,575,783 |
| Derivata finansiella tillgångar | 0 | 0 |
| Finansiella skulder värderade till verkligt värde via resultaträkningen | 1,368,044,139 | 790,712,170 |
| Derivata finansiella skulder | 0 | 0 |

*Vilka är de viktigaste riskerna som är specifika för utfärdaren?*

**Utfärdaren är ett företag med särskilda ändamål**: Utfärdaren är en enhet för särskilda ändamål vars enda verksamhet är att emittera av värdepapper. Utfärdarens enda sätt att göra betalningar avseende en serie värdepapper är de belopp som utfärdaren tar emot från realiseringen av Säkerhetstillgångarna (enligt definitionen nedan). För varje Serie kommer utfärdaren att skapa säkerhet över Säkerhetstillgångarna avseende den Serien till förmån för bland annat värdepappersinnehavarna i den Serien. I händelse av att säkerheten som skapats av utfärdaren verkställs, och intäkterna från sådan verkställighet är, efter att ha gjort betalning till alla högre rankade borgenärer, otillräckliga för att betala alla belopp som är skyldiga sådana värdepappersinnehavare i sin helhet, utfärdaren ska inte ha något ansvar, någon skyldighet eller skuld för eventuella betalningsbortfall och ingen av

värdepappersinnehavarna eller förvaltaren (eller någon annan part som agerar på deras vägnar) får vidta några ytterligare åtgärder för att återvinna sådana belopp.

**Terminskommissionshandlares anspråk**: Investerare bör vara medvetna om att de avtal som ingåtts mellan utfärdaren och terminskommissionshandlarna ("T**erminskommissionshandlaresavtalet**") inte innehåller begränsade regressbestämmelser med avseende på utfärdarens skyldigheter.

Det finns därför en risk att, med avseende på en fordran mot utfärdaren från en Marginallåneleverantör i relation till ett LS Marginal kontoavtal, om efter realisering i sin helhet av den säkerställda egendomen (antingen i form av likvidation eller verkställighet) med avseende på en serie värdepapper och tillämpning av tillgängliga kontanter i enlighet med tillämpliga prioritetsordningar och trustakten, en fordran kan kvarstå mot sådana tillgångar mot sådana tillgångar. hänförliga till andra utestående serier av ETP-värdepapper på en pro rata-basis. GWM Limited, som kan agera som registrerad mäklarhandlare med avseende på vissa serier av värdepapper (”**Registerad mäklarhandlare**”) har dock gått med på att hålla utfärdaren skadeslös mot alla förluster, kostnader, anspråk, åtgärder, krav eller kostnader som utfärdaren kan ådra sig som ett resultat av sådana anspråk från Marginallåneleverantören

**C Nyckelinformation om värdepapperen**

*Vilka är värdepapperens viktigaste egenskaper?*

Varje serie av värdepapper kommer antingen att vara kopplad till ett index (”**Indexet**”) eller kommer att följa en investeringsstrategi som kommer att beskriva hur intäkterna från emissionen av värdepapperen kommer att investeras tillsammans med eventuell hävstång som ska användas med avseende på sådan investeringsstrategi (”**Investeringsstrategin**”). Indexet eller investeringsstrategin kommer att referera till en eller flera tillgångar (”**Referenstillgångarna**”) som kan bestå av (i) aktier, (ii) räntebärande värdepapper, (iii) räntebärande värdepapper, (iv) andelar i börshandlade fonder; (v) värdepappersfonder (posterna (i) till (v), (”**Fysiska tillgångar**”) eller (vi) terminskontrakt och (vii) optionskontrakt.
Serier av börshandlade värdepapper kan erbjuda lång exponering med hävstång (“**Hävstångsexponeringar**”), korta inverserade hävstångsexponeringar (“**Korta exponeringar**”) eller +1x exponering (“**Normala exponeringar**”) för referenstillgångarna. Med avseende på serier av börshandlade värdepapper som erbjuder hävstångsexponeringar och korta exponeringar, kommer graden av hävstång eller omvänd hävstång att vara inbäddad i antingen (i) indexet eller investeringsstrategin; eller (ii) direkt i börshandlade värdepapperen. Graden av hävstång som kommer att gälla för varje serie av börshandlade värdepapper kommer att återspeglas i den tillämpliga hävstångsfaktorn (**"Hävstångsfaktorn"**). Serier av börshandlade värdepapper kan också emitteras som har till syfte att generera inkomster för att finansiera periodiska räntebetalningar (”**Inkomstserien**”). Investeringsstrategin för en inkomstserie kan också tillhandahålla en hävstångsexponering mot de relevanta referenstillgångarna, vars detaljer kommer att inkluderas i beskrivningen av investeringsstrategin.

Säkerhetsägandena med avseende på varje Serie av ETP-värdepapper är:

- i fallet med hävstångsexponeringar och normala exponeringar där referenstillgångarna är fysiska tillgångar: referenstillgångarna för det tillämpliga indexet eller investeringsstrategin för sådana serier av börshandlade värdepapper; Tilläggstillgångar (enligt definitionen nedan); och eventuella kontanter;
- i fallet med korta exponeringar där referenstillgångarna är fysiska tillgångar: marknadsvärdet för värdepapperslån; de sidotillgångar; och eventuella kontanter;

- i fallet med börshandlade värdepapper där referenstillgångarna är terminskontrakt: marknadsvärdet för terminskontrakten; de sidotillgångar; och eventuella kontanter;

- i fallet med Inkomstserier där referenstillgångarna är optionskontrakt: marknadsvärdet för optionskontrakten; eventuella underliggande tillgångar i optionskontrakten som förvärvats av utfärdaren för att (i) täcka dess exponering under optionerna i enlighet med investeringsstrategin eller (ii) som ett resultat av att optionskontrakten fysiskt regleras; sidotillgångar; och eventuella kontanter;

- I fallet med inkomstserier som erbjuder exponeringar där referenstillgångarna är fysiska tillgångar: referenstillgångarna för investeringsstrategin för sådana serier av börshandlade värdepapper; sidotillgångar; och eventuella kontanter.

i varje enskilt fall som det innehas på marginalkontot/-en som upprättats för den serien (”**Marginalkontot**” och ”**Säkerhetstillgångarna**”).

Belopp som står till kredit för ett marginalkonto med avseende på en serie av börshandlade värdepapper, i den utsträckning som inte krävs för att investeringar ska replikera utvecklingen av det relevanta indexet för den serien

eller för investeringar i enlighet med investeringsstrategin för den serien, kan på uppdrag av portföljförvaltaren upprätthållas som kassatillgodohavanden på marginalkontot eller placeras i den ursprungliga valutan av statspapper i en statspappersvaluta. än en månad som är betygsatt minst A-1 av Standard & Poor's Ratings Services, och/eller P-1 av Moody's Investors Service Ltd. och/eller F1 av Fitch Ratings Limited (”**Anknytande tillgångar**”).

I tillämpliga fall kommer varje serie av börshandlade värdepapper att referera till resultatet för det relaterade indexet eller investeringsstrategin under en daglig, veckovis, månadsperiod eller sådan annan period som anges i de Slutliga Villkoren (”**Ombalanseringsperioden**”). I slutet av varje ombalanseringsperiod kommer marginkontot att återskapas för att spåra indexets prestanda eller fullfölja investeringsstrategin.

Inlösenbeloppet för börshandlade värdepapperen kommer att härledas från likvideringen av säkerhetstillgångarna, som köpta eller sålda i enlighet med hävstångsfaktorn för sådana serier av börshandlade värdepapper.

För varje Inkomstserie ska utfärdaren göra betalningar av räntebelopp avseende börshandlade värdepapperen i den serien på det relevanta räntebetalningsdatumet som anges i de slutliga villkoren.

De börshandlade värdepapperen är fritt överlåtbara.

Varje serie av de börshandlade värdepapperna kommer endast att ge rätt till värdepappersinnehavare att delta i intäkterna från likvidationen av *en proportionell del*, med avseende på sådana värdepappersinnehavare, av säkerhetstillgångarna som hålls på det relevanta terminskommissionshandlarna -kontot med avseende på sådana serier, efter det proportionella avdraget av (i) alla kostnader och utgifter som utfärdaren ådragit sig i samband med likvidationen av sådana Säkerhetstillgångar; (ii) Arrangörsavgiften; och (iii) alla tillämpliga värdepappersutlåningsavgifter, mäklaravgifter, exponeringsunderhållsavgifter (som inkluderar den del som kan hänföras till varje serie (enligt beslutsombudet) av alla avgifter, kostnader och utgifter som kan ådras av utfärdaren för att ingå transaktioner eller instrument, förvärva tillgångar eller på annat sätt engagera sig i aktiviteter som den anser vara lämpliga för att kunna upprätthålla sin verksamhet eller på annat sätt vara rimlig för att kunna upprätthålla sin verksamhet och på annat sätt vara rimlig exponerings- och hävstångsnivåerna för de börshandlade värdepapperen) och kostnader för transaktionsskatter vid försäljning eller köp av referenstillgångarna (enligt definitionen nedan) (i tillämpliga fall) (”**Finansierings- och mäklaravgifter**”). Sådan likvidation kommer att äga rum på det sista inlösendatumet (enligt nedan) eller endast under begränsade omständigheter före detta datum.

På specificerade värderingsdagar ska ett **” Säkerhetsvärde”** beräknas av bestämningsagenten som ska återspegla värdet på säkerhetstillgångarna med avseende på en serie av de börshandlade värdepapperna justerat för att ta hänsyn till alla tillämpliga avgifter och utgifter.

För varje serie kommer utfärdaren att skapa säkerhet över säkerhetstillgångarna avseende den serien till förmån för bland annat värdepappersinnehavarna i den serien. Efter verkställigheten av säkerheten som beviljats av utfärdaren för varje serie, kommer förvaltaren att använda intäkterna från realiseringen av säkerhetstillgångarna som är föremål för säkerheten i den tillämpliga prioritetsordningen enligt vilken belopp som är skyldiga till säkerhetsinnehavarna kommer att vara underordnade alla kostnader, avgifter, utgifter och alla andra belopp inklusive (utan begränsning av fondens insättning) r, i varje enskilt fall i förhållande till säkerhetsinnehavarna.

Om, i förhållande till en serie av börshandlade värdepapper, nettointäkterna från realiseringen av säkerheten som skapats med avseende på sådana serier av utfärdaren är otillräcklig för att betala alla belopp som utfärdaren är skyldig de säkrade borgenärerna (andra än leverantören av marginallån) i fråga om den serien kommer inga andra tillgångar hos utfärdaren att vara tillgängliga för att täcka eventuella underskott och alla utestående fordringar från sådana säkerställda borgenärer kommer att utsläckas. Ingen part (annat än leverantören av marginallån) kommer att ha rätt att vidta ytterligare åtgärder mot utfärdaren för att få tillbaka ytterligare belopp.

***Problemspecifik sammanfattning:***

*Investeringsmål: Att följa LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy, som syftar till att generera månatliga intäkter genom att sälja optioner på Super Micro Computer, Inc. och betala en avkastning baserad på innehavda likvida medel. Strategin kan även handla med optioner i säkringssyfte.*

*Serier: IncomeShares Super Micro Computer (SMCI) Options ETP*

*ISIN: XS3299465412*

*Antal börshandlade värdepapper: 15000*

*De börshandlade värdepapper som emitterats i enlighet med dessa slutliga villkor är denominerade i USD.*

*Den sista förfallodagen för de börshandlade värdepapper är den 19/03/2076 (”**Sluta inlösendagen**”).*

*Varje börshandlade värdepapper har ett huvudbelopp på USD 10.00.*

*Var skulle värdepapperen handlas?*

***Problemspecifik sammanfattning:***

Ansökan har gjorts till Förenade kungarikets finansinspektion ("FCA") för att de börshandlade värdepapper som dessa slutliga Villkor gäller för att bli upptagna till Förenade kungarikets finansinspektions officiella lista. Ansökan har gjorts till Londonbörsen för att de de börshandlade värdepapper som dessa slutliga Villkor gäller för att få tas upp till handel på Londonbörsens huvudmarknad.
Ansökan har gjorts för att de serier av de börshandlade värdepapper som dessa ssutliga villkor gäller ska tas upp till notering och handel på börsen Euronext Amsterdam, den reglerade marknad som drivs av börsen Euronext Amsterdam.
Ansökan har gjorts till Frankfurtbörsen (Frankfurter Wertpapierbörse) för att de serier av de börshandlade värdepapper som dessa slutliga Villkor gäller för att bli upptagna till notering och handel på den tyska börsen Xetra.

*Vilka är de huvudsakliga riskerna som är specifika för värdepapperen?*

**EN INVESTERING I DE BÖRSHANDLADE VÄRDEPAPPER INNEBÄR EN BETYDLIG RISKGRAD**. Följande är de huvudsakliga riskfaktorerna som bör övervägas noggrant av potentiella investerare innan de beslutar om de ska investera i värdepapper. Investerare bör rådfråga sina egna finansiella, juridiska, redovisnings- och skatterådgivare om riskerna med en investering i värdepapper.
Marknadspriset för de börshandlade värdepapper: De börshandlade värdepapperna kan ha en lång löptid och det sista inlösendatumet kan vara upp till 50 år från det ursprungliga emissionsdatumet för serien.
Det enda sättet genom vilket en investerare kommer att kunna realisera värde från ett ETP-värdepapper före deras sista inlösendatum är att sälja det till dess då marknadspris i en sekundärmarknadstransaktion.

Marknadsskapande av auktoriserade deltagare: Investerare är beroende av att det finns en eller flera auktoriserade deltagare som skapar en marknad för de börshandlade värdepapperna för att ge investerarna likviditet. Investerare bör vara medvetna om att ingen auktoriserad deltagare är skyldig att skapa en marknad för någon serie av värdepapper och under omständigheter där en auktoriserad deltagare som skapar en marknad med avseende på någon serie av värdepapper, sådan auktoriserad deltagare kan när som helst sluta skapa en marknad. Om det inte finns några auktoriserade deltagare, eller om den eller de auktoriserade deltagarna inte effektivt skapar en marknad för värdepapper i en serie, kanske investerarna inte kan sälja några sådana-värdepapper inom en kort tidsperiod eller till ett pris nära säkerhetsvärdet för den serien. Om investerare inte kan sälja värdepapperen kommer de inte att kunna realisera sin investering förrän det sista inlösendatumet.

***Problemspecifik sammanfattning***

*Börshandlade värdepapper kopplade till en investeringsstrategi: Varje börshandlade värdepapper kommer att kopplas till prestanda för de referenstillgångar som hänvisas till i sådan investeringsstrategi. Investerare har inga äganderätter till några referenstillgångar i en investeringsstrategi. Det belopp som ska betalas vid inlösen av de börshandlade värdepapper kommer att bero på likvidationen av säkerhetstillgångarna i förhållande till den serien.*

*Börshandlade värdepapper kopplade till aktierelaterade värdepapper: Riskerna med ett börshandlade värdepapper kopplat till aktierelaterade värdepapper kan innefatta, men är inte begränsade till, möjligheten till betydande förändringar i priset/priserna på de relevanta aktierna. Värdet på de relevanta aktierna kan gå ner såväl som upp och värdet på alla relevanta aktier på vilket datum som helst kanske inte speglar deras prestationer under någon tidigare period. Det kan inte lämnas någon garanti om det framtida värdet av något aktiepapper eller om den fortsatta existensen av något eget kapital, skuld eller dess närstående företag. Följaktligen bör potentiella investerare noggrant överväga om en investering, vars avkastning kommer att bero på utvecklingen av aktierelaterade värdepapper, är lämplig för dem, innan de fattar ett investeringsbeslut med avseende på de börshandlade värdepapper.*

*Aktivt förvaltad investeringsstrategi: De börshandlade värdepappersinnehavare har ingen rätt att delta i förvaltningen av säkerhetstillgångarna för en serie de börshandlade värdepapper. Alla beslut med avseende på investeringen av intäkterna från emissionen av de börshandlade värdepapperen kommer att fattas i enlighet med LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy.Ingen person bör köpa några de börshandlade värdepapper om de inte är villiga att anförtro alla aspekter av förvaltningen av säkerhetstillgångarna till portföljadministratören för att investera i enlighet med LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy.Dålig prestanda för LS Super Micro Computer Options-Based Income Strategy kan negativt påverka värdet på de börshandlade värdepapperen, vilket kan resultera i att de börshandlade värdepappersinnehavarna får mindre eller väsentligt mindre än sin ursprungliga investering.*

*De börshandlade värdepapper kopplade till korta positioner i säljoptioner: att sälja säljoptioner exponerar de börshandlade värdepapperen för risken att priset på säljoptionens Underliggande tillgång faller under dess lösenkurs på lösendagen.Emittenten kan teckna säljoptionerna på en täckt basis genom att avsätta tillräckligt med kontanter för att uppfylla sina åtaganden enligt säljoptionerna. Emittenten får dock inte inneha kontanter för att täcka sin exponering under säljoptionerna, vilket kan orsaka en förlust eller tidig avveckling i den mån säljoptionerna är helt eller delvis avtäckta. Dessutom, i den mån säljoptionerna är fysiskt reglerade, kan emittenten från tid till annan behöva ta emot de underliggande tillgångarna. I den mån den äger de underliggande tillgångarna kommer emittenten att vara exponerad för risken att priset på de underliggande tillgångarna sjunker, vilket kan resultera i en minskning av säkerhetsvärdet på de de börshandlade värdepapper.*

**D Nyckelinformation om erbjudandet av värdepapper till allmänheten och/eller upptagandet till handel på en reglerad marknad**

*Under vilka villkor och tidtabeller kan jag investera i detta värdepapper?*

De börshandlade värdepapperen görs tillgängliga av utfärdaren för teckning endast för auktoriserade deltagare som utsetts av utfärdaren i förhållande till programmet och som har lämnat en giltig teckningsorder till utfärdaren. Nyemissioner av börshandlade värdepapper kommer i allmänhet att avvecklas på den andra London-bankdagen (dagen (annan än en lördag eller söndag) då affärsbanker och valutamarknader avvecklar betalningar i London) efter det datum då en giltig teckningsorder tas emot av utfärdaren, tillsammans med tillämplig avgift, förutsatt att en sådan order tas emot före kl. 14.30 London tid en sådan dag.

För varje serie av de börshandlade värdepapper omfattar de avgifter som ska betalas av de börshandlade värdepappersinnehavare följande komponenter: (i) en arrangörsavgift som debiteras med en ränta på 0.55% per år av de börshandlade värdepappersvärdet som innehas av en värdepappersinnehavare; (ii) relevanta finansierings- och mäklaravgifter som är föremål för justeringsavgifter; (iii) belopp som ska betalas till Irländska skattekommissionärer; (iv) belopp som ska betalas till Marginallåneleverantör och till ombudet som ansvarar för att förvalta och företräda en försäkringstagares försäkring; och (v) kostnaderna och utgifterna i samband med likvidationen av Säkerhetstillgångarna.

Utfärdaren kommer att föra över dessa kostnader på investerarna och därmed minska värdet på deras investering i värdepapperen. Utfärdaren kommer inte att debitera investerarna några andra kostnader.

***Problemspecifik sammanfattning:***

Ett erbjudande av ETP-värdepapper som inte omfattas av ett undantag från kravet på att offentliggöra ett prospekt enligt förordning (EU) 2017/1129 under den aktuella erbjudandeperioden kan lämnas i Irland, Italien, Tyskland, Frankrike, Spanien, Nederländerna, Polen, Belgien, Sverige, Norge och Österrike.

*Varför utarbetas detta prospekt?*

Skälen till erbjudandet och användningen av rutiner är vinstgenerering och/eller säkring.

***Problemspecifik sammanfattning:***

*Det uppskattade nettobeloppet av emissionslikviden är 70688.72 USD.*

Emittenten kommer att använda intäkterna från emissionen för att finansiera de relaterade Marginkontona enligt vad som kan krävas för att upprätthålla positioner i Referenstillgångarna i syfte att replikera (i den utsträckning det är praktiskt möjligt) avkastningen för Indexet eller för att följa den Investeringsstrategi som hänvisas till i Serien, med beaktande av tillämplig Hävstångsfaktor. Belopp som krediteras Marginkontot kan också, enligt Portföljförvaltarens gottfinnande, behållas som kontantbalanser på Marginkontot eller investeras i Bitägande Tillgångar.

Erbjudandet av börshandlade värdepapper är inte föremål för ett emissionsavtal med fast åtagande.

*Väsentliga intressekonflikter*

De auktoriserade deltagarna och/eller deras respektive dotterbolag kan vara aktiva handlare på vissa marknader. Dessa handelsaktiviteter kan utgöra en konflikt mellan innehavarna av värdepapperen och de intressen som auktoriserade deltagare och deras respektive dotterbolag kan ha i sina egna konton, i att underlätta transaktioner, inklusive optioner och andra derivattransaktioner, för sina kunder och på konton som de förvaltar. Dessa

handelsaktiviteter, om de påverkar investeringsstrategin, kan vara negativa för värdepapperens säkerhetsinnehavarnas intressen. De auktoriserade deltagarna och deras respektive dotterbolag kan också emittera eller garantera ytterligare värdepapper eller handla med andra produkter vars avkastning är kopplad till investeringsstrategin eller andra liknande strategier. En ökad investeringsnivå i dessa produkter kan negativt påverka investeringsstrategin och därför det belopp som ska betalas för sådana serier av värdepapper på deras angivna förfallodag eller något tidigare inlösendatum, beroende på vad som är tillämpligt, och marknadsvärdet på sådana värdepapper.

GWM Limited (som kan agera som Broker Dealer of Record och/eller Auktoriserad Deltagare i förhållande till en Serie av ETP-värdepapper), Flexinvest Limited (som kan agera som Portföljadministratör), FlexAdvisor Limited (som kan agera som Portföljadministratör) och Fastställandeagenten står under gemensamt ägande av Jose Gonzalez, som även är styrelseledamot och den yttersta majoritetsägaren i Arrangören. När sådana enheter agerar har de endast de uppgifter och det ansvar som uttryckligen avtalats i den relevanta rollen och ska inte, enbart genom att vara relaterade till en enhet som agerar i någon annan roll, anses ha andra uppgifter eller ansvar eller anses omfattas av en annan omsorgsstandard än vad som uttryckligen föreskrivs för var och en av dessa roller.