

SVENSKA
FONDHANDLARE
FÖRENINGEN

ORDLISTA

VERSION 6 – 2014-04-29
BEGREPP OCH DEFINITIONER AVSEENDE
STRUKTURERADE PLACERINGAR

BILAGA TILL BRANSCHKOD FÖR
STRUKTURERADE PLACERINGAR

Denna ordlista utgör ett hjälpmedel för att investeraren på ett enklare sätt skall kunna jämföra olika Arrangörers Marknadsföringsmaterial avseende Strukturerade Placeringar. Investeraren uppmanas att granska de begrepp och definitioner som återfinns i Marknadsföringsmaterialet för den specifika Strukturerade Placeringen.

Begrepp	Definition
Arrangör	Den som tar fram den Strukturerade Placeringen eller i Marknadsföringsmaterialet utformar information om placeringens egenskaper och risker.
Arrangörsarvode	Avgiftsuttaget i en Strukturerad Placering består av courtage och Arrangörsarvode. Arrangörsarvodet ingår i placeringens pris. Avgifterna redovisas i sin helhet i Marknadsföringsmaterialet.
Barriär	En nivå i den Underliggande Tillgångens värde där den Strukturerade Placeringens avkastningsberäkning förändras. Kan också benämnas inlösenbarriär, kupongbarriär och riskbarriär.
Betalningsdag	Se ”Likviddag”.

Begrepp	Definition
Bevis	En Strukturerad Placering där Emittenten inte har åtagit sig att återbetala minst Nominellt Belopp på Återbetalningsdagen. En del av det investerade beloppet kan dock ha ett Återbetalningsskydd. Synonym: "Certifikat".
Certifikat	Se "Bevis".
Deltagandegrad	Anger hur stor del av utvecklingen i den eller de Underliggande Tillgångarna som investeraren får ta del av vid beräkning av Återbetalningsbeloppet.
Distributör	Den som, på uppdrag av Arrangör eller Emittent, säljer, marknadsför eller på annat sätt förmedlar Strukturerade Placeringar.
Emissionsdag	Den dag som den Strukturerade Placeringen ges ut av Emittenten och som normalt sett är den dag som placeringen registreras som ett värdepapper i relevant clearingsystem.
Emissionskurs	Det pris i procent av Nominellt belopp som investeraren betalar för placeringen (exklusive courtage). Exempelvis är Emissionskursen för en Kapitalskyddad Placering med 10 procent Överkurs 110 procent av Nominellt Belopp. Emissionskursen kan även uttryckas i kronor. Synonymer: "Pris", "Teckningskurs".
Emittent	Den som är utgivare av en Strukturerad Placering, upprättar prospekt samt därmed är betalningsskyldig enligt den Strukturerade Placeringens Slutliga Villkor.
Genomsnittsberäkning	Startkursen eller Slutkursen för den eller de Underliggande Tillgångarna beräknas som ett genomsnitt av kurserna vid ett antal förutbestämda tillfällen.
Grundprospekt	Den handling som upprättats enligt lag och som tillsammans med Slutliga Villkor innehåller information som bedöms nödvändig för att en investerare ska kunna göra en välgrundad bedömning av Emittenten och den Strukturerade Placeringen. Se även "Slutliga Villkor".
Kapitalskyddad Placering	En Strukturerad Placering där Emittenten har åtagit sig att återbetala minst 100 procent av det Nominella beloppet på Återbetalningsdagen. En Kapitalskyddad Placering kan erbjudas till Överkurs, dock ska Överkursen ligga i nivå med rådande marknadspraxis.
Kupong	En ränta eller annan avkastning som kan utbetalas vid flera tillfällen under Löptiden. Kupongen kan beräknas på olika sätt.
Kursrörlighet	Svängningar i kursen på Underliggande Tillgångar. Synonym: "Volatilitet".

Begrepp	Definition
Likviddag	Den dag då betalning för den Strukturerade Placeringen ska erläggas av investeraren. Synonym: ”Betalningsdag”.
Lägsta Återbetalning	Det lägsta belopp i kronor eller procent av Nominellt Belopp som en Emittent åtagit sig att återbetala i ett Bevis/Certifikat.
Löptid	Används för att ange perioden mellan Emissionsdag och Återbetalningsdag.
Marknadsföringsmaterial	För varje Strukturerad Placering ska ett Marknadsföringsmaterial upprättas i form av en broschyr eller motsvarande som beskriver placeringens egenskaper och risker.
Mätperiod	Begreppet används för att ange den tidsperiod som tillämpas vid Genomsnittsberäkning av Startkurs eller Slutkurs.
Nominellt Belopp Pris	Det belopp som en Strukturerad Placering är utställd på. Se ”Emissionskurs”.
Referenstillgång	Se ”Underliggande Tillgång”.
Slutdag	Den eller de dagar då Slutkurs fastställs, alternativt sista dagen i en period då Genomsnittsberäkning tillämpas.
Slutkurs	Den eller de Underliggande Tillgångarnas värde på respektive Slutdag, alternativt genomsnittlig kurs i det fall Genomsnittsberäkning tillämpas.
Slutliga Villkor	Dokument som innehåller de specifika villkoren för en Strukturerad Placering. Se även ”Grundprospekt”.
Startdag	Den eller de dagar då Startkurs fastställs, alternativt den första dagen i en period då Genomsnittsberäkning tillämpas.
Startkurs	Den eller de Underliggande Tillgångarnas värde på respektive Startdag, alternativt genomsnittlig kurs i det fall Genomsnittsberäkning tillämpas.
Strukturerade Placeringar	Samlingsbegrepp för värdepapper vars avkastning är beroende av utvecklingen i en eller flera Underliggande Tillgångar, exempelvis aktier, valutor eller råvaror.
Teckningskurs	Se ”Emissionskurs”.
Teoretiskt Slutvärde	Ett beräknat värde som en Strukturerad Placering skulle få på Återbetalningsdagen, givet den eller de Underliggande Tillgångarnas värde idag.

Begrepp	Definition
Tilläggsbelopp	Det belopp i en Strukturerad Placering som läggs till eller dras ifrån Nominellt Belopp vid betalning på Återbetalningsdagen. Observera att Tilläggsbeloppet kan vara negativt för Bevis/Certifikat vilket medför att Återbetalningsbeloppet kan bli lägre än Nominellt Belopp.
Underliggande Tillgång	Den eller de tillgångar som refereras till vid beräkning av Återbetalningsbelopp för den Strukturerade Placeringen. Synonym: ”Referenstillgång”.
Volatilitet	Se ”Kursrörlighet”.
Återbetalningsbelopp	Det belopp som investeraren är berättigad att erhålla på Återbetalningsdagen.
Återbetalningsdag	Den dag som Emittenten ska betala ut Återbetalningsbeloppet till investeraren.
Överkurs	Det belopp som erläggs av investeraren utöver det Nominella Beloppet. Överkurs uttrycks ofta som en procentsats relaterad till Nominellt Belopp.