

SVENSKA
FONDHANDLARE
FÖRENINGEN

SPIS ORDLISTA

VERSION 7 - 2018-01-24
BEGREPP OCH DEFINITIONER AVSEENDE
STRUKTURERADE PLACERINGAR

1. BAKGRUND

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

2. BEGREPP OCH DEFINITIONER

Begrepp

Definition

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 en Lägsta Återbetalning. 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 distribuerar en Strukturerade Placeringar. Att distribuera en Strukturerad Placering omfattar att erbjuda eller ge råd om en Strukturerad Placering.
Emissionsdag	Den dag som den Strukturerade Placeringen ges ut 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 vanligtvis är betalningsskyldig enligt den Strukturerade Placeringens Slutliga Villkor.

Begrepp

Definition

Genomsnittsbereäkning

Startkursen eller Slutkursen för den eller de Underliggande Tillgångarna beräkns som ett genomsnitt av kurserna vid ett antal förutbestämde 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.

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".

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.

Begrepp

Definition

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 Genomsnittsbereäkning av Startkurs eller Slutkurs.

Nominellt Belopp

Det belopp som en Strukturerad Placering är utställd på.

Pris

Se "Emissionskurs".

Producent

Den som uppfyller kraven för att producera en Strukturerad Placering i enlighet med MiFID II. Att producera en Strukturerad Placering kan innefatta att skapa, utveckla, emittera och utforma den Strukturerade Placeringen.

Referenstillgång

Se "Underliggande Tillgång".

Slutdag

Den eller de dagar då Slutkurs fastställs, alternativt sista dagen i en period då Genomsnittsbereäkning tillämpas.

Slutkurs

Den eller de Underliggande Tillgångarnas värde på respektive Slutdag, alternativt genomsnittlig kurs i det fall Genomsnittsbereäkning tillämpas.

Begrepp

Definition

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 Genomsnittsbekning tillämpas.

Startkurs

Den eller de Underliggande Tillgångarnas värde på respektive Startdag, alternativt genomsnittlig kurs i det fall Genomsnittsbekning 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.

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.

Begrepp**Definition**

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 Utvecklaren 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.