**Bilaga 17. Avprickningslista för prospekt.**

# Värdepapper som skapar betalnings- eller leveransskyldigheter kopplade till en underliggande tillgång

Emittent:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **1 RISKFAKTORER** | | | |
| **Punkt enligt kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980** | **Kategori** | **Sidor i prospektet** | **Bolagets kommentarer** |
| 1.1 Information på framträdande plats i ett avsnitt med rubriken ”Riskfaktorer” om de riskfaktorer som är väsentliga för de värdepapper som erbjuds och/eller tas upp till handel, så att en bedömning kan göras av de marknadsrisker som är förenade med värdepapperen. I tillämpliga fall ska detta inbegripa en varning om att investerare kan förlora hela värdet av investeringen eller en del av detta beroende på omständigheterna; om investerarens ansvar inte är begränsat till värdet på investeringen ska detta anges tillsammans med en beskrivning av de omständigheter under vilka ett sådant utvidgat ansvar uppkommer och dess troliga finansiella följder. | A |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **2 INFORMATION OM DE VÄRDEPAPPER SOM ERBJUDS/TAS UPP TILL HANDEL** | | | |
| **Punkt enligt kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980** | **Kategori** | **Sidor i prospektet** | **Bolagets kommentarer** |
| 2.1 Information om värdepapperen |  |  |  |
| 2.1.1 En tydlig och fullständig förklaring som kan bidra till investerarnas förståelse av hur värdet på deras investeringar påverkas av värdet på det eller de underliggande instrumenten, särskilt under de förhållanden då riskerna är som mest uppenbara, såvida inte värdepapperens nominella värde per enhet är minst 100 000 EUR eller de inte kan förvärvas för mindre än 100 000 EUR per enhet eller om de ska handlas på en reglerad marknad eller ett särskilt segment därav till vilken eller vilket endast kvalificerade investerare kan få tillträde. | B |  |  |
| 2.1.2 Stängnings- eller förfallodag för derivatinstrumenten och deras lösendag eller slutliga referensdag. | C |  |  |
| 2.1.3 En beskrivning av förfarandet för avveckling av derivatinstrumenten. | B |  |  |
| 2.1.4 En beskrivning av  a) förfarandet för avkastning på derivatinstrumenten,  b) betalnings- eller leveransdag,  c) dess beräkningsmetod. | B  C  B |  |  |
| 2.2 Information om det underliggande instrumentet |  |  |  |
| 2.2.1 Lösenpris eller sista noterade pris för det underliggande instrumentet. | C |  |  |
| 2.2.2 En redogörelse för typen av underliggande instrument.  Närmare uppgifter om var man kan få information om det underliggande instrumentet, inbegripet var man på elektronisk väg kan få information om dess tidigare resultat, fortsatta utveckling och volatilitet, och huruvida denna information är gratis.  Om det underliggande instrumentet är ett värdepapper:  a) Namn på den emittent som utfärdat värdepapperet.  b) Internationellt standardnummer för värdepapper (ISIN).  Om det underliggande instrumentet är en referensenhet eller en referensförpliktelse (i fråga om kreditlänkade värdepapper):  a) När referensenheten eller referensförpliktelsen utgörs av en enda enhet eller förpliktelse, eller när det rör sig om en pool av underliggande instrument där en enda referensenhet eller referensförpliktelse motsvarar minst 20 % av polen:  i) Om referensenheten (eller emittenten av referensförpliktelsen) inte har några värdepapper upptagna till handel på en reglerad marknad, likvärdig tredjelandsmarknad eller tillväxtmarknad för små och medelstora företag, och i den utsträckning emittenten vet och/eller kan utröna av information som offentliggjorts av referensenheten (eller av emittenten av referensförpliktelsen), information om referensenheten (eller emittenten av referensförpliktelsen) som om den vore emittent (i enlighet med registreringsdokumentet för icke-aktierelaterade värdepapper som erbjuds till investerare i grossistledet).  ii) Om referensenheten (eller emittenten av referensförpliktelsen) redan har värdepapper upptagna till handel på en reglerad marknad, likvärdig tredjelandsmarknad eller tillväxtmarknad för små och medelstora företag, och i den utsträckning emittenten vet och/eller kan utröna av information som offentliggjorts av referensenheten (eller av emittenten av referensförpliktelsen), dennes namn, internationella standardnummer för värdepapper (ISIN), adress, registreringsland, bransch(er) där referensenheten (eller emittenten av referensförpliktelsen) verkar och namnet på den marknad där dess värdepapper är upptagna till handel.  b) När det rör sig om en pool av underliggande instrument där en enda referensenhet eller referensförpliktelse motsvarar mindre än 20 % av polen:  i) Namnen på referensenheterna eller emittenterna av referensförpliktelsen.  ii) Internationellt standardnummer för värdepapper (ISIN).  Om det underliggande instrumentet är ett index:  (a) Indexets namn.  (b) En beskrivning av indexet, om det har satts samman av emittenten eller en juridisk person som tillhör samma koncern.  (c) En beskrivning av indexet som tillhandahålls av en juridisk eller fysisk person som agerar i förening med eller på uppdrag av emittenten, såvida inte prospektet innehåller följande uttalanden:  i) Att indexets fullständiga regelverk och information om dess resultat finns fritt tillgängliga på emittentens eller indextillhandahållarens webbplats.  ii) Att reglerna för indexet (inklusive dess metodik för urval och ombalansering av indexets komponenter, beskrivning av marknadsstörande händelser samt justeringsregler) bygger på förhandsbestämda och objektiva kriterier.  Leden b och c ska inte gälla om administratören av indexet finns med i det offentliga register som förs av Esma i enlighet med artikel 36 i förordning (EU) 2016/1011[[1]](#footnote-1).  (d) Om indexet inte har satts samman av emittenten, uppgift om var information om indexet kan erhållas.  Om det underliggande instrumentet är en ränta, en beskrivning av denna ränta.  Om det underliggande instrumentet inte tillhör någon av de ovan angivna kategorierna, ska värdepappersnoten innehålla likvärdig information.  Om det underliggande instrumentet är en korg av underliggande instrument, uppgifter om respektive underliggande instrument enligt ovan och relevanta vikttal för varje underliggande instrument som ingår i korgen. | A  C  C  C  A  C  C  C  C  A  B  C  C  C  C |  |  |
| 2.2.3 En beskrivning av störande händelser på marknaden eller vid avveckling eller kredithändelser som berör det underliggande instrumentet. | B |  |  |
| 2.2.4 Regler om justering för händelser som berör det underliggande instrumentet. | B |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **3 YTTERLIGARE INFORMATION** | | | |
| **Punkt enligt kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980** | **Kategori** | **Sidor i prospektet** | **Bolagets kommentarer** |
| 3.1 En upplysning i prospektet om huruvida emittenten avser att rapportera information efter emissionen. Om emittenten anger sin avsikt att rapportera sådan information, ska den specificera i prospektet vilken information som kommer att rapporteras och var den kan erhållas. | C |  |  |

1. Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 av den 8 juni 2016 om index som används som referensvärden för finansiella instrument och finansiella avtal eller för att mäta investeringsfonders resultat, och om ändring av direktiven 2008/48/EG och 2014/17/EU och förordning (EU) nr 596/2014. [↑](#footnote-ref-1)