

# Warrant European Bonds Lock-In Kupong NR 2202

SISTA TECKNINGSDAG 20 MAJ 2022

RISK ENLIGT SRI  
LÄGRERISK

1

2

3

4

5

6

7

HÖGRE RISK

EMITTENT	Leonteq Securities AG, Guernsey
GARANT	TCM - Collateralised Derivatives
KREDITRISK	Fitch: BBB- / JCR:BBB+
ISIN	CH0588517794
UNDERLIGGANDE	Strategi på likaviktad korg av räntefonder
DELTAANDEGRAD	100 %
HÄVSTÄNG	11,76 (indikativt)
KUPONG	10 % - Lock-In
PRIS PER POST	8 % (800 SEK) + courtage
NOMINELLT BELOPP	10 000 SEK
LÖPTID	ca 5 år
VALUTA	SEK (avkastning beroende av utveckling i EUR)
KAPITALSKYDD	Nej
DISTRIBUTÖR	Sirius Asset Management AB SIP Nordic Fondkommission AB

## MÅLGRUPPSINFORMATION

### KUNDTYP

ICKE-PROFESSIONELL	PROFESSIONELL	JÄMBÖRDIG MOTPART
--------------------	---------------	-------------------

### KUNSKAPSNIVÅ

GRUNDLÄGGANDE	INFORMERAD	AVANCERAD
---------------	------------	-----------

### FÖRMÅGA ATT BÄRA FÖRLUST

INGEN	BEGRENSAD	TOTAL	> INVESTERING
-------	-----------	-------	---------------

### INVESTERINGSMÅL

BEVARANDE	TILLVÄXT	KASSAFLÖDE	RISKHANTERING	HÄVSTÄNG
-----------	----------	------------	---------------	----------

### LÄGSTA REKOMMENDERADE INNEHAVSTID (ÅR)

MYCKET KORT (<1 ÅR)	KORT (1-3 ÅR)	MEDEL (3-5 ÅR)	LÅNG (>5 ÅR)
---------------------	---------------	----------------	--------------

### DISTRIBUTIONSSTRATEGI

A	B	C	D
---	---	---	---

■ POSITIV MÅLGRUPP ■ NEUTRAL MÅLGRUPP ■ NEGATIV MÅLGRUPP

PRODUKTKATEGORI Hävstångsinstrument

PRODUKTENÄMNING Marknadswarrant

## PRIVATE PLACEMENT - Max 149 erbjudanden

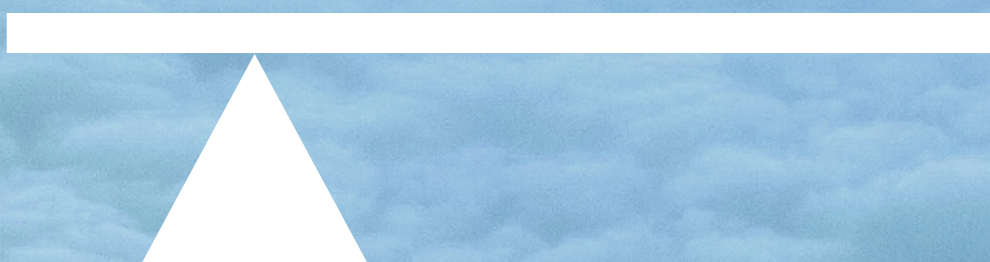
### TIDSPLAN

- 4 april 2022 - Säljperiod startar
- 20 maj 2022 - Sista teckningsdag
- 27 maj 2022 - Sista dag då betalningen måste finnas på anvisat bankkonto/bankgiro

- 2 juni 2022 - Placeringens startdag
- 16 juni 2022 - Leverans av värdepapper
- 16 juni 2027 - Återbetalningsdag och tidigaste tidpunkt för återbetalning ifall någon inlösen inte har skett tidigare

**Marknadsföringsmaterial** Historisk avkastning ger inte någon garanti för framtida avkastning. Investeringar innebär risktagande och investerat kapital kan komma att öka eller minska i värde. Placeringen har framförallt två risker - att emittent inte kan fullgöra sina åtaganden och marknadsrisken. Placeringen är tänkt att hållas löptiden ut. Läs mer under Viktigt om risker.

# Räntefonders risk kombinerat med möjlighet till hävstång





### Räntefonders låga risk kombinerat med hög hävstång

Sirius Warrant European Bonds Lock-In Kupong är en fem år lång placering med en målvolatilitet om 4 procent. Om den historiska 20-dagarsvolatiliteten överstiger 4 procent minskas exponeringen och om den historiska 20-dagarsvolatiliteten understiger 4 procent ökar exponeringen. Exponeringen mot index kan som lägst uppgå till 0 procent och som högst till 200 procent. Avkastningspotentialen motsvaras av utvecklingen för underliggande index multiplicerat med deltagandegraden om 100 %<sup>1</sup> (som fastställs på startdagen och kan bli både högre och lägre än indikerat). Index är ett Överavkastningsindex (Excess Return), vilket innebär att avkastningen från index dynamiskt reduceras med Euribor 3M<sup>2</sup>. På slutdagen är återbetalning beroende av att emittenten kan fullfölja sina åtaganden och betala ut kapitalet. Placeringen denomineras och är valutasäkrad i svenska kronor (SEK), ingen valutarisk föreligger således under placeringens löptid.

#### Warrant European Bonds Lock-In Kupong

Denna placering ger exponering med hävstång vid positiv utveckling för en investeringsstrategi som ämnar förbättra riskprofilen för en korg bestående av räntefonderna, likaviktade med daglig balansering, Fidelity - European High Yield Fund, HSBC - Euro High Yield Bond, Nordea - European High Yield Bond Fund och Aberdeen - Select Euro High Yield Bond Fund. Detta sker genom tre olika mekanismer.

För det första, en volatilitetskontroll som ämnar att, över tid, stabilisera volatiliteten genom att öka exponeringen mot underliggande korg vid lägre volatilitet (kursrörelse). På samma sätt minskas exponeringen vid högre volatilitet. Exponeringen rör sig dynamiskt i relation till uppmätt volatilitet i intervallet 0 - 200 procent, det vill säga, mellan 0 - 20 000 kr fondandelar per post.

För det andra, en utbetalande kupong av uppnådd positiv strategiutveckling i intervaller om 5 procent. Vid exempelvis 10 procent strategiutveckling (2 st kupongutbetalningar) har investeraren fått kupongutbetalningar som överstiger investerat belopp.

För det tredje, en extern och oberoende riskhantering för att minimera emittentrisken (TCM).

Vid positiv utveckling för underliggande strategi ger placeringen möjlighet till hög avkastning i relation till investerat belopp. Vid oförändrad eller negativ utveckling på slutdagen förfaller placeringen värdelös.

#### TCM - Hantering av kreditrisk mot emittent

Som ett led i att minska risken i placeringen används så kallad tredjeparts-riskhantering för att minimera kreditrisken mot placeringens emittent. Detta genom att en oberoende extern part i form av SIX Securities Services AG, vilket är samma aktör som driver den schweiziska börsen, träder in som säkerhetsagent mellan investeraren och utfärdaren av placeringen, dvs. emittenten eller banken.

I praktiken fungerar detta på så vis att emittenten av placeringen deponerar specifika säkerheter motsvarande värdet av placeringen på ett segregerat (skyddat) konto hos SIX Securities Services, som sedan håller dessa säkerheter till förmån för investerarna under placeringens löptid. Tanken är således att dessa specifika säkerheter skall användas för att täcka eventuella förpliktelser gentemot investerare i händelse av att placeringens emittent råkar ut för en så kallad insolvens- eller kredithändelse.

Som administratör och säkerhetsagent är SIX Securities Services en helt neutral och oberoende tredje-part i den underliggande investerings-transaktionen och övervakar kontinuerligt värdet på den utgivna placeringen samt den av emittenten utställda säkerheten för placeringen och har löpande kontroll över att dessa motsvarar varandra. I det fall emittenten skulle bli föremål för ett kredit- eller insolvensförfarande kommer alltså SIX Securities Services att likvidera den ställda säkerheten till investerarnas förmån och ett belopp motsvarande värdet av placeringen återbetalas.

+ Bred ränteexponering med historiskt hög riskjusterad avkastning

+ Hög hävstång då varje post i placeringen ger 10 000 SEK i exponering

- Full risk på investerat kapital, hela eller delar av kapitalet kan förloras

- Break-even nivå på 8,0 % indexutveckling (exkl. courtage)

<sup>1</sup> Den indikativa deltagandegraden som anges i detta marknadsföringsdokument överensstämmer med deltagandegraden som anges i faktabladet ("KID"). Denna nivå är endast vägledande och kan variera nedåt eller uppåt.

<sup>2</sup> Euribor3M var vid materialets framställande -0,458 %

<b>NAMN</b>	2202 Warrant European Bonds Lock-In Kupong
<b>EMITTENT</b>	Leonteq Securities AG, Guernsey (BBB- enl. Fitch och BBB+ enl. JCR)
<b>GARANT</b>	TCM - Collateralised Derivatives
<b>ISIN</b>	CH0588517794
<b>PRIS PER POST</b>	800 SEK + courtage
<b>COURTAGE</b>	130 SEK
<b>MINSTA TECKNINGSPOST</b>	200 poster (170 000 SEK)
<b>LÖPTID</b>	Ca 5 år
<b>UNDERLIGGANDE EXPONERING</b>	Leonteq European High Yield Bonds 4%RC Index (Bbg: LEONEHY4)
<b>VOLATILITET</b> (kursrörlighet)	Index är ett målvolatilitetsindex (Volatility Target Index) och använder en mekanism som styr realiserad volatilitet till 4,0 %.
<b>STARTKURS</b>	2022-06-02 - stängningskurs för index
<b>EMISSIONSDAG</b>	2022-06-16
<b>SLUTKURS</b>	2027-06-02 - stängningskurs för index
<b>ÅTERBETALNINGSDAG</b>	2027-06-16
<b>VALUTA</b>	SEK på slutdag. Avkastningen beroende av växelkursen SEK/EUR.
<b>VALUTAFAKTOR</b>	Växelkursen mellan svenska kronor (SEK) och Euro (EUR) på varje kupongtillfälle samt sista dagen av Exponeringstiden dividerat med växelkursen mellan SEK och EUR på startdagen.
<b>DELTAGANDEGRAD</b>	Indikativt 100 % (lägst 80 %) mot underliggande index.
<b>UTVECKLING INDEX</b>	Slutkurs/Startkurs -1
<b>KAPITALSKYDD</b>	Nej.
<b>ÅTERBETALNING</b>	Om Indexutvecklingen är högre än summan av tidigare utbetalade kuponger i procent utbetalas: <b>Nominellt belopp x Deltagandegrad x Utveckling index - Summan av tidigare utbetalade kuponger i procent x Valutafaktor</b>  annars  <b>Utbetalas noll</b>
<b>NOTERING</b>	Ja, Emittent noterar produkten på Frankfurter Wertpapierbörse (Freiverkehr).

Fullständiga villkor återfinns i Prospektet. Vänligen se [https://structuredproducts-ch.leonteq.com/services/prospectuses?language\\_id=1](https://structuredproducts-ch.leonteq.com/services/prospectuses?language_id=1)

### Tidsplan

4 april 2022	- Säljperiod startar	2 juni 2022	- Placeringens startdag
20 maj 2022	- SISTA TECKNINGSDAG	16 juni 2022	- Leverans av värdepapper
27 maj 2022	- Sista dag då betalningen måste finnas på anvisat bankkonto/bankgiro	16 juni 2027	- Återbetalningsdag och tidigaste tidpunkt för återbetalning

Investeringar i finansiella instrument kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att Investeringen får tillbaka hela det investerade kapitalet. Det investerade beloppet kan under löptiden både öka och minska i värde. Återbetalningen är beroende av emittentens finansiella förmåga att fullgöra sina förpliktelser.

## UNDERLIGGANDE INDEX - BESKRIVNING

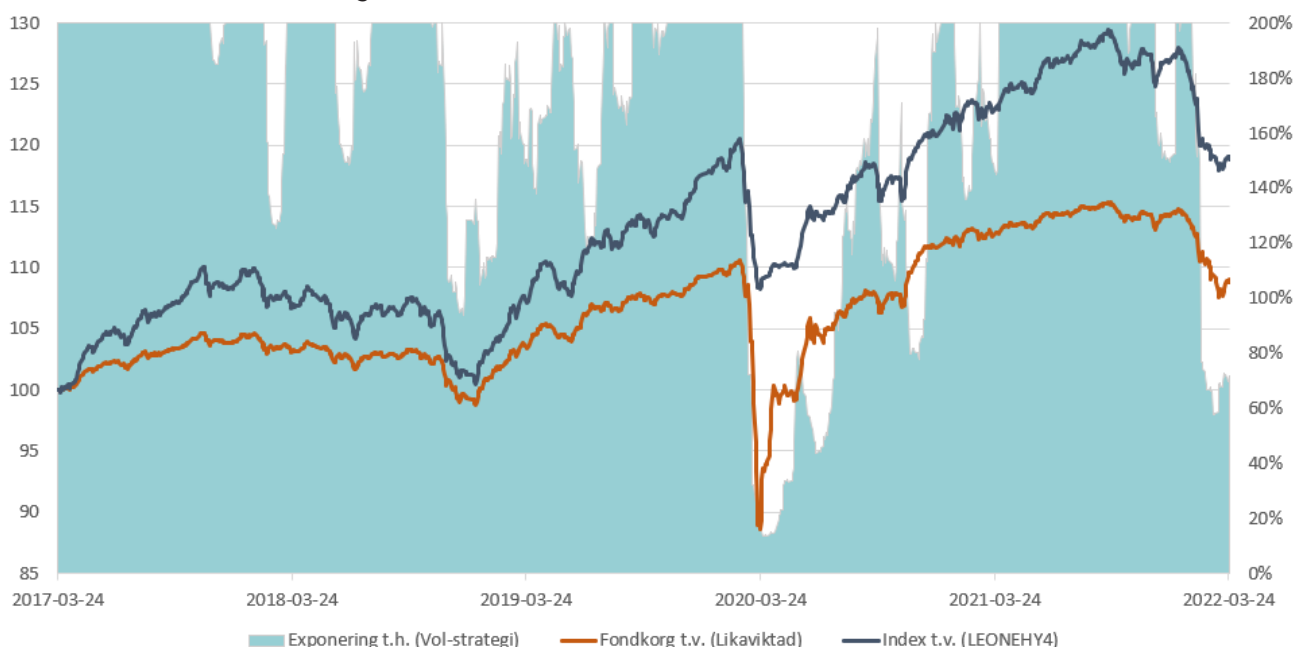
**Produktens Underliggande** består av en investeringsstrategi på en likaviktad korg av fonder (se sid. 13 för index innehav). Kursutveckling för denna investeringsstrategi uttrycks som ett index.

**Volatilitetskontroll:** Index är ett målvolatilitetindex (Volatility Target Index) och använder en mekanism som syftar till att styra realiserad volatilitet (prisrisk) till en viss nivå vilken för aktuell produkt är 4,0 procent. Mekanismen mäter realiserad volatilitet för Strategikorg under en rullande 20 dagar lång period och justerar därefter dagligen Dynamiskt Deltagande.

Exempel: en realiserad volatilitet om 3,2 procent resulterar i ett Dynamiskt Deltagande om 125,0 procent (målvolatilitet / realiserad volatilitet = 4,0/3,2). Lägre realiserad volatilitet leder till högre Dynamiskt Deltagande och omvänt. Dynamiskt Deltagande är för aktuell produkt begränsat till maximum 200,0 respektive minimum 0,0 procent.

**Avkastningsindex:** Index är ett Överavkastningsindex (Excess Return), vilket innebär att avkastningen från Strategikorg dynamiskt reduceras med Euribor3M ränta

Simulerad historisk kursutveckling, normaliserad: 2016-05-03 - 2022-03-24



Källa: Bloomberg, 2022-03-24. Historisk avkastning är inte en garanti för framtida avkastning.

### RÄKNEEXEMPEL \*\*\*

Nedan visas exempel på avkastning från placeringen baserat på en investering om 930 kr, dvs. 1 post om 800 kr plus courtage om 130 kr och nominellt belopp om 10 000 kr. Tabellen visar återbetalningsbelopp i form av antal utbetalda kuponger à 1 000 kr, baserat på oförändrade valutaförhållanden, samt effektiv avkastning beräknat på 5 års löptid.

SLUTKURS (nivå på Räntekorg och/eller Strategi)	ANTAL UTBETALDA KUPONGER	ÅTERBETALT BELOPP (BRUTTO)	TOTAL AVKASTNING	EFFEKTIV ÅRLIG AVKASTNING
135 %	3 x 1000 kr	3 500 kr	276 %	30,35 %
130 %	3 x 1000 kr	3 000 kr	223 %	26,39 %
125 %	2 x 1000 kr	2 500 kr	169 %	21,87 %
120 %	2 x 1000 kr	2 000 kr	115 %	16,55 %
115 %	1 x 1000 kr	1 500 kr	61 %	10,03 %
110 %	1 x 1000 kr	1 000 kr	8 %	1,46 %
105 %	0	500 kr	-46 %	-11,67 %
100 %	0	0 kr	-100 %	-100,00 %
95 %	0	0 kr	-100 %	-100,00 %
90 %	0	0 kr	-100 %	-100,00 %

## MARKNADSFÖRINGSMATERIAL

Denna informationsbroschyr utgör endast marknadsföring och ger inte en komplett bild av produkten. Mer information finns i det av producenten upprättade basfaktabladet (KID) och prospektet som innehåller en komplett beskrivning. Innan beslut tas om en investering ska invest-

erare förses med faktabladet, det fullständiga prospektet och, i förekommande fall, slutliga villkor. Informationen kan erhållas genom att kontakta Sirius Asset Management AB på telefon +46 (0)31-39 00 300 alternativt info@siriusam.se.

## OM RISKER

En investering i placeringen är förenad med ett antal riskfaktorer. Nedan sammanfattas de viktigaste riskerna. För mer utförlig information om dessa och övriga risker vänligen se emittents prospekt.



### OM KREDITRISK

Vid investering i krediter tar investeraren kreditrisk på emittenten som ger ut placeringen. Med kreditrisk menas att emittenten inte skulle kunna fullfölja sina åtaganden gentemot investeraren. Med åtaganden avses återbetalning på inlösen eller återbetalningsdagen samt löpande kupongutbetalningar. Om emittenten skulle hamna på obestånd riskerar investeraren att förlora hela sin investering oavsett hur underliggande exponering har utvecklats. Emittentens kreditvärdighet kan förändras i såväl positiv som negativ riktning och ett sätt att bedöma kreditrisken är utifrån det kreditbetyg som erhållits från oberoende värderingsinstitut såsom exempelvis Standard & Poor's och Moody's.

Kreditbetyget ger en bild av företagets eller bankens långsiktiga förmåga att klara sina betalningsåtaganden. Högsta betyg som kan erhållas är AAA och Aaa, medan C och D är lägst. Information finns på standardandpoors.com och moodys.com. Investeringen omfattas inte av den statliga insättningsgarantin. I händelse av att en resolutionsmyndighet bedömer att emittenten riskerar att bli insolvent eller inte kunna leva upp till förekommande kapitalkrav har dessa rätten att besluta om att emittentens respektive garantens skulder ska skrivas ned. Detta kan resultera i att investerare förlorar hela eller delar av sin investering samt att placeringen kan komma att avslutas i förtid.



### OM LIKVIDITETSRISK (ANDRAHANDSMARKNAD)

Denna strukturerade produkt ska i första hand ses som en investering under hela dess livslängd. SIP Nordic Fondkommission AB ställer köpkurser på andrahandsmarknaden. Vid onormala marknadsförhållanden kan andrahandsmarknaden vara mycket illikvid, vilket kan göra det svårt eller omöjligt att sälja produkten. Kurserna på andrahandsmarknaden kan vara såväl högre som lägre än investerat belopp. Kurserna på andrahandsmarknaden beräknas med vedertagna matematiska modeller och beror på underliggande marknadsutveckling, volatilitet (kursrörlighet) i marknaden, aktuellt ränteläge, återstående löptid och aktuella kreditbetyg. Courtage kan tillkomma vid försäljning på andrahandsmarknaden. Emittenten kan även i vissa begränsade situationer lösa in placeringen i förtid och det förtida inlösenbeloppet kan då vara såväl högre som lägre än det ursprungliga investerade beloppet.



### OM MARKNADSAVBROTT OCH SÄRSKILDA HÄNDELSER

Om marknadsavbrott eller andra särskilda händelser inträffar kan emittenten behöva göra vissa ändringar i beräkningen eller byta ut den underliggande tillgången mot en annan. Det är viktigt att investeraren läser mer om detta i de slutliga villkoren samt i emittentens prospekt.



### OM VALUTARISK

---

Produkten är noterad i en specificerad valuta som kan vara annorlunda än investerarens egna valuta. Investeringen uppmanas att läsa emittentens prospekt samt denna marknadsföringsbroschyr för att se hur aktuell produkt eventuellt påverkas av förändringar i valutakurs.



### OM KOMPLEXITET

---

Du står i begrepp att köpa en produkt som inte är enkel och som kan vara svår att förstå. Avkastningen i strukturerade produkter bestäms ibland av komplicerade samband som kan göra det svårt att jämföra placeringen med andra placeringsalternativ. Denna produkt passar enbart individer som har tillräcklig kunskap om denna typ av strukturerade produkt, och du bör sätta dig in i hur denna specifika placering fungerar innan du köper.



### OM EXPONERINGSRISK

---

En investering i strukturerade produkter kan ge en annan avkastning än en direktinvestering i underliggande tillgång. Under löptiden påverkas värdet på en strukturerad produkt av flera faktorer såsom underliggandes marknadsutveckling, återstående löptid, förväntad framtida volatilitet, marknadsräntor, eventuella aktieutdelningar och emittentens uppläningskostnad. Även förändringar i legala förutsättningar kan påverka värdet. För mer information om underliggande exponering hänvisas till emittents prospekt och slutliga villkor.



### OM PRISRISK/VOLATILITET

---

Prisvolatilitet eller Kursrörlighet avser hur stora prisförändringar som sker i genomsnitt under en bestämd tidsperiod, vanligtvis uttryckt som % per år. Om man antar att Kursrörligheten per dag är 1 krona (upp eller ned) för en aktie som kostar 100 kronor, så motsvarar det 16 procent volatilitet per år. Om aktiens Kursrörlighet per dag är 50 öre, så motsvarar det 8 procent volatilitet. Priset för en option styrs till största delen av nivån på volatiliteten, där högre volatilitet ger ett högre pris på en köpoption.



### OM RÄNTERISK

---

Ränteförändringar under löptiden kan påverka placeringens marknadsvärde negativt eller positivt. Marknadsvärdet kan därför avvika från ett förväntat värde baserat på utvecklingen i den underliggande tillgången.



### RISKKLASSIFICERING (SRI)

---

Riskindikatorn på framsidan syftar till att illustrera risk på investerat belopp utifrån PRIIPS (Packaged Retail Insurance-based Investment Products). Riskmålet gäller för alla strukturerade placeringar i EU och benämns som SRI (Summary Risk Indicator). Med utgångspunkt i en sju-gradig skala (1-7) beräknas SRI utifrån två underliggande mått: emittentens kreditrisk (CRM - Credit Risk Measure) och volatiliteten i underliggande marknad (MRM - Market Risk Measure). 1 är låg risk och 7 är hög risk.

---

## ÖVRIGT OM BROSCHYREN - INDIKATIVA VILLKOR

Villkoren som anges i detta marknadsföringsdokument är endast vägledande och kan variera nedåt eller uppåt. Villkoren är beroende av gällande förutsättningar på aktie-, råvaru-, ränte- och valutamarknaden och de slutgiltiga villkoren fastställs på Startdag. Information om fastställda villkor samt produktens utveckling under löptiden finns tillgängliga på [www.sipnordic.se](http://www.sipnordic.se).

---

### Sirius Asset Management AB

Sirius är anknutet ombud till SIP Nordic Fondkommission AB, organisationsnummer 556708-6649, (SIP), vilket innebär att du som kund också är kund till SIP som är ett svenskt värdepappersbolag med tillstånd av Finansinspektionen att verka enligt lagen om värdepapper. Genom att vara anknutet ombud kan Sirius verka under SIP:s tillstånd och namn med investeringsrådgivning och orderförmedling av värdepapper. SIP tar då ansvar för att denna verksamhet följer de regler och riktlinjer som råder på värdepappersmarknaden enligt lag och att du som kund erhåller det kundskydd du har rätt till.

På framsidan av detta marknadsföringsdokument anges till vilken målgrupp denna finansiella produkt skall marknadsföras och distribueras till. En målgrupp är en definierad gruppering av slutkunder som fastställs genom kvantitativ och kvalitativ analys av sex kategorier och deras inbördes relation. En delkategori som är förenlig med slutkund anses vara Positiv (grönmarkerad). En delkategori som rimligen under förutsebara omständigheter är oförenlig med slutkund anses vara Negativ (rödmarkerad). Om en delkategori inte kan anges som Positiv eller Negativ skall den anses vara Neutral (blåmarkerad).



### KUNDTYP

- **ICKE-PROFESSIONELL**
- **PROFESSIONELL**
- **JÄMBÖRDIG MOTPART**

Icke-professionell kund åtnjuter det högsta kundskyddet men omgärdas också av en del restriktioner. Icke-professionell kund kan ansöka om att bli omklassificerad som professionell kund men förlorar då det högre kundskyddet.



### KUNSKAP OCH ERFARENHET

**Grundläggande** - en icke-professionell investerare som saknar erfarenhet, insikt och kunskap utöver vad som presenteras i dokumentationen och marknadsföringsmaterial för produkten vid försäljningstillfället. En sådan investerare har förmågan att förstå investeringens utfallsrum och under vilka villkor ett specifikt utfall sker och har en förståelse om dess förväntade avkastning. Investeringen skall vara i stånd att göra ett informerat beslut gällande investeringen baserat på denna information.

**Informerad** - en icke-professionell investerare som har tidigare erfarenhet, insikt och kunskap om en liknande investering eller innehar specialkunskap om investeringens specifika risker vid försäljningstillfället. En sådan investerare har förmågan att göra ett informerat beslut gällande investeringen baserat på tidigare erfarenhet, insikt och kunskap.

**Avancerad** - en icke-professionell investerare som kan ta ett informerat beslut baserat på betydande och ingående erfarenhet, insikt och kunskap om relevanta investeringsprodukter i allmänhet eller icke-professionell investerare som erhåller specifikt professionellt investeringsråd om investeringen eller vara en utkomst av professionell diskretionär förvaltningshjälp.



### EKONOMISK SITUATION MED FOKUS PÅ FÖRMÅGA ATT BÄRA FÖRLUST

- **INGEN** - Investeringen har ingen förmåga att bära förlust. Små begränsade förluster p.g.a. kostnader är möjliga.
- **BEGRÄNSAD** - Investeringen söker bevara ett kapital och har förmåga att bära förlust som är begränsad till den nivå som specificeras av investeringen.
- **TOTAL** - Investeringen har förmåga att bära 100 % förlust på investeringen.



### RISKTOLERANS

Investerare vars skattade risktolerans överensstämmer med produktens SRI ingår i positivmålgrupp. Är SRI lägre än kundens skattade risktolerans kategoriseras kunden som neutral målgrupp och är SRI högre kategoriseras kunden som negativ målgrupp. Detta gäller för investeringsrådgivning avseende en enskild produkt. I det fall rådgivningen avser en portfölj är det portföljens sammanvägda SRI som styr målgruppsbestämningen.



### INVESTERINGSMÅL

- **BEVARANDE** - kapitalet ska vara skyddat mot nedgång
- **TILLVÄXT** - kapitalet ska ha potential att växa
- **KASSAFLÖDE** - kapitalet ska generera kontinuerliga utbetalningar
- **RISKHANTERING** - kapitalet ska kunna växa oberoende av marknadsutveckling
- **HÄVSTÅNG** - kapitalet ska ge hög avkastning i förhållande till investerat belopp



### LÄGSTA REKOMMENDERADE INNEHAVSTID (ÅR)

<b>MYCKET KORT</b>	< 1 år
<b>KORT</b>	1-3 år
<b>MEDEL</b>	< 5 år
<b>LÅNG</b>	> 5 år



### DISTRIBUTIONSSTRATEGI

- A) Distribution** i egen regi (orderutförande - utan passandebedömning, gäller endast okomplicerade produkter)
- B) Distribution** i egen regi (orderutförande - med passandebedömning)
- C) Distribution** via mellanhänder (investeringsrådgivning via rådgivare/anknutna ombud - med lämplighetsprövning)
- D) Diskretionär** portföljförvaltning - med lämplighetsprövning

Produkten ska i första hand distribueras till den målgrupp som definieras som positiv, enligt fastställd distributionsstrategi. Skulle produkten i ett diversifierande syfte distribueras inom ramen för investeringsrådgivning eller portföljförvaltning, kan produkten distribueras till neutral målgrupp.



# Övrigt

## HISTORISK ELLER SIMULERAD HISTORISK UTVECKLING

Information markerad med \* avser historisk information och eventuell information markerad med \*\* avser simulerad historisk information. Simulerad information är baserad på SIP Nordics eller emittentens egna beräkningsmodeller, data och antaganden och en person som använder andra modeller, data eller antaganden kan nå annorlunda resultat. Investerare bör notera att varken faktisk eller simulerad historisk utveckling är en garanti för eller en indikation om framtida utveckling eller avkastning samt att produktens löptid kan avvika från de tidsperioder som använts i detta marknadsföringsmaterial.

## RÄKNEEXEMPEL

Information markerad med \*\*\* utgör endast exempel för att underlätta förståelsen av placeringen. Räkneexemplet visar hur avkastningen beräknas baserat på rent hypotetiska avkastningsnivåer. De hypotetiska beräkningarna ska inte ses som en garanti för eller en indikation om framtida utveckling eller avkastning.

## RÅDGIVNING

Om produkten är en lämplig respektive passande investering måste alltid bedömas utifrån varje enskild investerarens egna förhållanden och denna broschyr utgör inte investeringsrådgivning. Du måste själv bedöma lämpligheten i att investera i placeringen ur eget perspektiv alternativt rådgöra med en rådgivare. En investering i placeringen är endast passande för dig som har tillräcklig erfarenhet och kunskap för att själv bedöma riskerna med investeringen och den är endast lämplig för dig som dessutom har investeringsmål som stämmer med den aktuella produkten.

Varken distributör, producent eller emittent tar något ansvar för värdeutvecklingen av produkten och lämnar inga som helst muntliga eller skriftliga, direkta eller indirekta garantier eller åtaganden avseende det slutliga utfallet av en investering.

## BESKATTNING

Produkten kan bli föremål för beskattning. Investerare bör rådgöra med professionell skatteexpertis om de skattemässiga konsekvenserna av en investering utifrån sina egna förhållanden. Skattesatser och andra skatteregler, såväl svenska som utländska, beror på investerarens individuella omständigheter och kan förändras under innehavstiden.

## NOTERING

En ansökan om att notera placeringen kommer att ges in men det finns ingen garanti att en sådan ansökan kommer att godkännas.

## ÅTERBETALNINGSDAG

Med återbetalningsdag och kupongutbetalningsdag avses tidigaste dag för återbetalning eller utbetalning av kupong. Tidigaste dag för återbetalning eller utbetalning av kupong framgår av emittentens grundprospekt och slutliga villkor. Återbetalning och utbetalning är beroende av den centrala värdepappersförvararens och/eller en eller flera clearinginstitutets betalningsrutiner vilket kan leda till att återbetalning eller utbetalning sker senare än tidigaste dag.

## INTRESSEKONFLIKTER

Sirius har organisatoriska rutiner avseende bland annat passandebedömning/lämplighetsbedömning och beslutsdualitet mellan SIP Nordic Fondkommission AB och Sirius.

Sirius hanterar därefter den potentiella intressekonflikten genom informationsgivning utifrån lagen om värdepappersmarknaden. Kunden informeras bland annat om att rådgivningen sker på icke oberoende grund och att rådgivningen avser finansiella produkter som kan utgöra Sirius egna produkter eller närstående bolags produkter. En intressekonflikt kan uppstå i samband med teckning av denna produkt med anledning av att Sirius har ett intresse och incitament att fullteckna produkten med anledning av att Sirius tar fram produkten.

Sirius informerar särskilt kunden att rådgivningen är baserad på en begränsad analys av olika finansiella instrument och att urvalet är begränsat till finansiella instrument utgivna, utfärdade eller tillhandahållna av Sirius.

## SELLING RESTRICTIONS

THE PRODUCT MAY NOT BE LEGALLY OR BENEFICIALLY OWNED AT ANY TIME BY ANY "U.S PERSON" (AS DEFINED IN REGULATION S PROMULGATED UNDER THE U.S SECURITIES ACT 1933, AS AMENDED ("REGULATION S")) AND ACCORDINGLY IS BEING OFFERED AND SOLD OUTSIDE THE UNITED STATES TO PERSONS THAT ARE NOT "U.S PERSONS" IN RELIANCE ON REGULATION S.

BY ITS PURCHASE OF THE PRODUCT, EACH PURCHASER WILL BE DEEMED OR REQUIRED, AS THE CASE MAY BE, TO HAVE AGREED THAT IT MAY NOT RESELL OR OTHERWISE TRANSFER THE PRODUCT HELD BY IT, EXCEPT OUTSIDE THE UNITED STATES IN AN "OFFSHORE TRANSACTION" (AS DEFINED IN REGULATION S) TO A PERSON THAT IS NOT A "U.S PERSON".

## SVENSK VÄRDEPAPPERS-MARKNAD OCH ORDLISTA

SIP Nordic Fondkommission AB följer rekommendationer Svensk Värdepappersmarknad tagit fram för vissa strukturerade placeringar. Tillhörande ordlista finns tillgänglig på [www.svenskvardepappersmarknad.se](http://www.svenskvardepappersmarknad.se)

# Kostnader och ersättningar

## COURTAGE

SIP Nordic Fondkommission AB (SIP) erbjuder endast Strukturerade Placeringar till framtagningskostnad. Förmedlare eller rådgivare ersätts i form av ett så kallat Courtage som betalas direkt av investeraren för erhållande av placering och/eller råd och är en avgift som läggs till på tillverkningsskostnaden/emissionspriset vid en affär. Courtage får uppgå till max 20 % av investerat belopp men aldrig överstiga 5 % av nominellt belopp. Uttryckt i kronor avrundas courtaget uppåt till närmaste hela 10 kronor. Courtaget skiljer sig emellertid mellan produkter och kan således vara lägre än aktuellt max-courtage. Avseende denna placering, vänligen se nedan tabell. SIP administrerar denna avgift för rådgivarens räkning.

## KVALITETSHÖJANDE ÅTGÄRDER

SIP har i sin rådgivning, via distributionsavtal med olika värdepappersbolag, tillgång till en stor mängd diversifierade produkter som möjliggör att en passande produkt kan erbjudas kunden.

Vid avsaknad av lämpliga produkter, eller för att ytterligare utöka produktutbudet, kan SIP bistå en emittent i produktframtagningsprocessen, distributionen och i uppföljningsarbetet.

Som distributör erhåller SIP en ersättning från emittenten. Aktuell maximal ersättning från denna placering beräknas som en procentsats på nominellt belopp vilken finns specificerad i nedan tabell. Som distributör erbjuder SIP sina

kunder en individuell rådgivning för kundens hela ekonomi och placeringar. De certifierade rådgivarna ska säkerställa att lämnade råd och produkter är anpassade efter kundens individuella mål och behov, samt utgör de bästa av likvärdiga tillgängliga produkter. Kunden erhåller placeringsalternativ och objektiv information, samt konsekvenserna för dessa alternativ. Ett stort produktutbud möjliggör en bättre bas för rekommendationer, men kräver även en större behovs- och portföljanalys.

## EMITTENTARVODE

Även emittenten av en strukturerad produkt tar ut ett arvode för att täcka kostnader för produktion, riskhantering och distribution av produkten. Arvodet är inkluderat i produktens pris och kan variera och definieras olika mellan olika emittenter. För komplett beskrivning av den specifika produktens emittentarvode, se nedan under Totalkostnad.

## ANMÄLAN & BETALNING

Anmälan är bindande och ska vara SIP tillhanda senast sista teckningsdag. Betalning görs mot erhållande av avräkningsnota och ska vara SIP tillhanda senast sista betalningsdag.

**BANKGIRO:** 320-7768 (SIP Nordic Fondkommission AB)

**KLIENTMEDELSKONTO:** SEB - 5851 10 632 42 (SIP Nordic Fondkommission AB)

## TOTALKOSTNAD

Totalkostnaden för denna placering enligt nedan tabell utgörs av Distributörsarvode, plus Courtage men exklusive Emittentarvode. Emittentarvode för 2202 European Bonds Lock-In Kupong uppgår indikativt till 2,30 %, 230 kronor, av nominellt belopp.

Kostnadspost	Kronor	Nominellt Belopp	Investerat Belopp
<b>Maximalt Distributörsarvode</b>	<b>50</b>	<b>0,50 %</b>	<b>6,25 %</b>
<b>Sirius Courtage</b>	<b>50</b>	<b>0,50 %</b>	<b>6,25 %</b>
<b>Courtage rådgivare</b>	<b>80</b>	<b>0,80 %</b>	<b>10,00 %</b>
<b>Total Kostnad</b>	<b>180</b>	<b>1,80 %</b>	<b>22,50 %</b>



**S\*AM är specialiserat på finansiella produkter. Personalen har lång branschfarenhet och med nationell närvaro, unik kunskap och lång erfarenhet ser vi fram emot att erbjuda väl genomtänkta finansiella placeringar.**

S\*AM är anknutet ombud till SIP Nordic Fondkommission AB och kommer bl.a. distribuera strukturerade produkter åt SIP.

I samarbete med ledande svenska och internationella investmentbanker har vi fokus på kundanpassade lösningar med utgångspunkt i rådande marknadsförutsättningar och ett svenskt investeringsfokus både för privata och institutionella investerare.

Efterfrågan påverkas av globala konjunktursvängningar såväl som investerares riskbenägenhet och förväntningar på den framtida ekonomin. S\*AM är länken mellan marknaderna och finans där vi erbjuder skräddarsydda placeringslösningar som kombinerar möjligheter och risk på ett transparent och kostnadseffektivt sätt. Det ska vara enkelt att utvärdera placeringarna samtidigt som god riskjusterad avkastning med konkurrenskraftiga avgifter kommer gynnas över tid.

SIRIUS ASSET MANAGEMENT

GÖTEBORG  
Kungsportsavenyn 21

STOCKHOLM  
Strandvägen 1

VÄXEL  
031 39 00 300

MAIL  
[info@siriusam.se](mailto:info@siriusam.se)

# Underliggande Index

Ingående fonder

## FONDKORG

VIKT	TICKER	NAMN	ISIN	REGION	TILLGÅNGSSLAG
25 %	FIDEHYA	Fidelity Funds - European High Yield Fund	LU0251130802	Europa	Räntor
Fonden strävar efter en hög inkomst- och kapitalstegring genom att främst investera i högavkastande europeiska företagsobligationer hos emittenter som har sitt huvudkontor eller som utövar en övervägande del av sin verksamhet i västra, centrala och östra Europa (inklusive Ryssland). Den typ av räntebärande värdepapper kommer inte att behöva uppfylla en minimivärderingsstandard eller uppbära ett värderingsbetyg utfärdat av ett internationellt erkänt kreditvärderingsinstitut					
25 %	NIMEHEU	Nordea 1 Sicav - European HY Bond Fund	LU0141799501	Europa	Räntor
Fonden investerar i europeiska högränteobligationer och syftar till att överträffa den totala europeiska högräntemarknaden. Fondförvaltarna fokuserar på att välja ut krediter baserat på ren bottom-up-analys. De förlitar sig på en djupgående förståelse för emittentens grunder och säkerheter för att slå marknaden. Förvaltarna skyddar investeringar utanför Euro genom att valutasäkra tillgångarna till Euro vilket uppnås via derivat.					
25 %	ABEEHYA	Aberdeen SICAV - Select Euro HY Bond Fund	LU0119176310	Europa	Räntor
Fonden försöker uppnå en kombination av avkastning och tillväxt genom att främst investera i obligationer (vilka liknarlån som kan ge en fast eller rörlig ränta) utfärdade av stater eller företag i euro. Obligationerna har vanligtvis lägre kreditbetyg från internationella kreditvärderingsinstitut men de kan ge högre ränta än obligationer med högre betyg. Fonden är avsedd för investerare som är beredda att acceptera en hög risknivå.					
25 %	HSBEHEC	HSBC Global Investment Funds - Euro HY Bond	LU0165092213	Europa	Räntor
Fonden strävar efter att ge långsiktig totalavkastning genom att investera i en portfölj med högavkastande obligationer denominerade i Euro. Fonden investerar (normalt minst 90% av nettotillgångarna) i räntebärande värdepapper som är Non-Investment Grade och andra värdepapper med högre avkastning (inklusive obligationer) som antingen emitteras av företag eller emitteras eller garanteras av staten, statliga myndigheter eller överstatliga organ på både utvecklade marknader och tillväxtmarknader.					

Källa: Morningstar, 2022-03-31