



OPn strukturoitujen lainojen markkina-arvoraportti

29.5.2020

Osake-, valuutta- ja hyödykerakenteet					
Arvostushetki	ISIN-Koodi	Lainan nimi	Nollakuponkilainana ¹	Optio ²	Lainan arvo
29.5.2020	FI4000167341	OMX30 13/2015	100.01	3.69	103.70
29.5.2020	FI4000170675	HEX25 14/2015	99.57	9.63	109.20
29.5.2020	FI4000201363	Öljy-Yhtiöt Booster 11/2016	99.69	-11.04	88.65
29.5.2020	FI4000257498	Terveys Autocall 8/2017	100.00	25.70	125.70
29.5.2020	FI4000266549	Metsä Obligaatio 10/2017	100.00	3.20	103.20

² Osallistumisaste huomioiden

Korko- ja luottoriskirakenteet			
Arvostushetki	ISIN-Koodi	Lainan nimi	Lainan markkina-arvo ³
29.5.2020	FI4000094784	Yritysluotto Eurooppa 5/2014	108.51
29.5.2020	FI4000099254	CLN Maailma 6/2014	87.34
29.5.2020	FI4000115340	Luottokori Eurooppa 11/2014	81.35
29.5.2020	FI4000125356	Eurooppakori USD 1/2015	135.35
29.5.2020	FI4000153671	CLN Maailma 6/2015	99.85
29.5.2020	FI4000157300	Amerikka USD 8/2015	86.80
29.5.2020	FI4000176458	Luottokori Amerikka 20/2015	79.00
29.5.2020	FI4000176359	Luottokori Eurooppa 19/2015	91.12
29.5.2020	FI4000201330	Luottokori Amerikka USD 10/2016	85.15
29.5.2020	FI4000207147	Luottokori Amerikka USD 12/2016	85.55
29.5.2020	FI4000242953	CLN Maailma 2/2017	66.20
29.5.2020	FI4000251822	Luottokori Amerikka USD 7/2017	82.40
29.5.2020	FI4000266655	Luottokori Amerikka USD 11/2017	86.65

³ Sisältäen kertyneet korot

Hybridituotteet					
Arvostushetki	ISIN-Koodi	Lainan nimi	Korko-osa ⁴	Optio	Lainan arvo
29.5.2020	FI4000178272	Tuotto-Extra HEX25 21/2015	89.45	34.05	123.50

⁴ Luottoriski huomioiden

VASTUUNRAJOITUS:

Tässä raportissa ilmoitetut markkina-arvot on toimitettu Teille tiedoksi pyynnöstänne ja tarkoitettu vain Teidän yksinomaiseen käyttöönne eikä raporttia tai markkina-arvoja saa jäljentää, jakaa tai julkaista missään tarkoituksessa ilman Pohjola Pankki Oyj:n ("Pohjola") antamaa kirjallista etukäteislupaa.

Tässä raportissa ilmoitettu markkina-arvo on arvio raportista ilmenevän arvopaperin/johdannaissopimuksen markkina-arvosta raportista ilmenevänä päivänä. Markkina-arvo on määritetty käyttäen hyväksi julkisesti luotettavina pidetyistä lähteistä saatua tietoa ja Pohjola on antanut sen vilpittömässä mielessä sen näkemyksen mukaan, joka Pohjolalla on markkina-arvosta arvostushetkellä. Useat tekijät vaikuttavat markkina-arvon määrittymiseen eikä näitä kaikkia ole välttämättä otettu huomioon markkina-arvoa määritettäessä, minkä vuoksi markkina-arvo voi poiketa merkittävästi arvoista, joita on mahdollisesti saatavissa muilta välittäjiltä tai muista lähteistä. Markkina-arvo voi poiketa myös siitä arvosta, jota Pohjola käyttää omassa kirjapidossaan tai raportoinnissaan. Markkina-arvoa ja arvostusmallia voidaan muuttaa ilman etukäteisilmoitusta. Pohjolalla ei ole velvollisuutta päivittää markkina-arvoa. Raportin vastaanottajan tulee tarvittaessa olla yhteydessä tilintarkastajiinsa tai muihin asiantuntijoihin markkina-arvon tarkoituksenmukaisuuden arvioimiseksi.

Tämän raportin tarkoituksena ei ole myydä eikä ostaa tai tarjota ostettavaksi, myytäväksi tai merkittäväksi tai tarjoutua ostamaan tai myymään mitään arvopaperia, rahoitustuotetta tai johdannaissopimusta, eikä raportissa ilmoitettu markkina-arvo ole osto- tai myyntihinta, jonka perusteella olisi tai olisi ollut mahdollista ostaa tai myydä mitään arvopaperia, rahoitustuotetta tai johdannaissopimusta. Markkina-arvon antamisesta ei voida myöskään päätellä, että markkina-arvon kohteella olisi aktiivisesti toimivat markkinat.

Pohjolalla voi olla raportissa mainituista arvopapereista, johdannaisista tai niihin liittyvistä sijoituksista koostuva positio ja Pohjola voi myydä, ostaa tai tarjoutua ostamaan tai myymään tällaisia arvopapereita, johdannaisia tai sijoituksia markkinoilla tai muulla tavoin.

Tiedustelut: Pohjola Markets, Strukturoidut tuotteet
structured.products@pohjola.fi
010 252 3081