



OPn strukturoitujen lainojen markkina-arvoraportti

29.7.2016

Osake-, valuutta- ja hyödykerakenteet

Arvostushetki	ISIN-Koodi	Lainan nimi	Nollakuponkilaina ¹	Optio ²	Lainan arvo
29.7.2016	FI4000071006	Kaivosyhtiöt Autocall 16/2013	100.00	-41.90	58.10
29.7.2016	FI4000147871	Europankit Autocall 3/2015	100.00	-40.80	59.20
29.7.2016	FI4000148739	Öliviäti Autocall 4/2015	100.00	-40.15	59.85
29.7.2016	FI4000167267	Fortum Autocall 12/2015	100.00	10.90	110.90
29.7.2016	FI4000167341	OMX30 13/2015	99.85	1.70	101.55
29.7.2016	FI4000170675	HEX25 14/2015	98.09	2.61	100.70
29.7.2016	FI4000170808	UPM Autocall 18/2015	100.00	11.65	111.65
29.7.2016	FI4000188883	TeliaSonera Booster 1/2016	100.00	-3.40	96.60
29.7.2016	FI4000189006	Nokia Takuukorko 2/2016	100.00	-10.25	89.75
29.7.2016	FI4000192505	Fortum Autocall 6/2016	100.00	10.15	110.15
29.7.2016	FI4000192430	Stora Enso Takuukorko 7/2016	100.00	4.95	104.95
29.7.2016	FI4000201272	Nokia Takuukorko 9/2016	100.00	3.10	103.10
29.7.2016	FI4000201363	Ölvi-Yhtiöt Booster 11/2016	99.44	7.11	106.55
29.7.2016	FI4000210414	Metsä Takuukorko 13/2016	100.00	1.50	101.50
29.7.2016	FI4000210349	Teräsytöt Autocall 14/2016	100.00	10.90	110.90

¹ Pääomaturvan ja mahdollisen takuutuoton nykyarvo² Osallistumisaste huomioiden

Korko- ja luottoriskirakenteet

Arvostushetki	ISIN-Koodi	Lainan nimi	Lainan markkina-arvo ³
29.7.2016	FI4000029772	Pohjola Suomi FtD 9/2011	101.92
29.7.2016	FI4000031687	Pohjola Euroopa FtD 12/2011	101.80
29.7.2016	FI4000031554	Pohjola Luottokori 11/2011	103.53
29.7.2016	FI4000041413	Pohjola Stora Enso 4/2012	102.12
29.7.2016	FI4000041769	Pohjola Luottokori Pohjois-Amerikka 5/2012	102.98
29.7.2016	FI4000041884	Pohjola Luottokori Suomi III 7/2012	103.76
29.7.2016	FI4000043377	Pohjola Luottokori Eurooppa 8/2012	137.43
29.7.2016	FI4000048673	Pohjola Eurooppa CLN 12/2012	107.93
29.7.2016	FI4000052287	Metsä Board -Korko 18/2012	104.28
29.7.2016	FI4000052295	Pohjola Luottokori Eurooppa 19/2012	99.86
29.7.2016	FI4000059134	Metsälaina 2/2013	104.37
29.7.2016	FI4000060827	Nokia Korko 6/2013	105.61
29.7.2016	FI4000062203	Yritysluotto Eurooppa 7/2013	108.91
29.7.2016	FI4000066865	Autot Korko 12/2013	105.17
29.7.2016	FI4000071378	Luottokori Eurooppa 17/2013	102.69
29.7.2016	FI4000094784	Yritysluotto Eurooppa 5/2014	106.83
29.7.2016	FI4000099254	CLN Maailma 6/2014	87.86
29.7.2016	FI4000115340	Luottokori Eurooppa 11/2014	90.10
29.7.2016	FI4000125356	Eurooppakori USD 1/2015	109.13
29.7.2016	FI4000153671	CLN Maailma 6/2015	89.13
29.7.2016	FI4000157300	Amerikka USD 8/2015	98.18
29.7.2016	FI4000176458	Luottokori Amerikka 20/2015	100.83
29.7.2016	FI4000176359	Luottokori Eurooppa 19/2015	101.73
29.7.2016	FI4000201330	Luottokori Amerikka USD 10/2016	101.64
29.7.2016	FI4000207147	Luottokori Amerikka USD 12/2016	102.10

³ Sisältäen kertyneet korot

Hybridituotteet

Arvostushetki	ISIN-Koodi	Lainan nimi	Korko-osa ⁴	Optio	Lainan arvo
29.7.2016	FI4000178272	Tuotto-Extra HEX25 21/2015	77.05	23.80	100.85

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 julkaisua 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 määritykseen eikä näitä kaikkia ole välttämättä otettu huomioon markkina-arvoa määritettäessä, minkä vuoksi markkina-arvo voi poiketa merkittävästi arvioista, joita on mahdollisesti saatavissa muilta välittäjiltä tai muista lähteistä. Markkina-arvo voi poiketa myös siitä arvosta, jota Pohjola käyttää omassa kirjapidosaan 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 osettavaksi, 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, johdannaista tai niihin liittyvistä sijoituksista koostuva positio ja Pohjola voi myydä, ostaa tai tarjoutua ostamaan tai myymään tällaisia arvopapereita, johdannaista tai sijoituksia markkinalla tai muulla tavoin.

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