VERWIJZINGSTABEL Bijlage 17 Prospectusverordening

Minimale informatievereisten voor effecten met van een onderliggende waarde afhankelijke verplichting tot betaling of levering

**Invulinstructies:**

* Graag de gegevens in onderstaande tabel invullen.
* Per rubriek vermelden op welke pagina’s en in welke paragrafen van het prospectus de vereiste informatie is opgenomen. De AFM verzoekt u zo specifiek mogelijk te verwijzen. Indien u ook een versie van het prospectus aanlevert dat de wijzigingen toont, graag naar deze versie verwijzen.
* Als de vereiste informatie niet gegeven kan worden omdat deze niet aansluit bij de activiteiten of rechtsvorm van de uitgevende instelling of bij de effecten, dan dient vergelijkbare informatie opgenomen te worden.
* Wanneer geen vergelijkbare informatie beschikbaar is, graag vermelden dat de rubriek ‘niet van toepassing’ is samen met een korte uitleg waarom de informatie niet vermeld kan worden.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Uitgevende instelling: |  | | |
| Titel prospectus: |  | | |
| Prospectusverordening  Bijlage nrs.: |  | | |
| Datum conceptprospectus: |  | Concept nr.: |  |
| Datum commentaar AFM: | *[Graag openlaten voor de AFM]* | | |
| Lezers AFM: | *[Graag openlaten voor de AFM]* | Tel. nr.: | *[Graag openlaten voor de AFM]* |
| *De AFM behoudt zich het recht voor om additioneel commentaar te maken op een later moment.* | | | |

|  |  |
| --- | --- |
| Nr. | ALGEMEEN COMMENTAAR EN ANTWOORDEN |
|  | *[Graag openlaten voor de AFM]* |
|  |  |
|  |  |

| Rubriek nr. | Inhoud rubriek van Bijlage 17 | Pagina en paragraaf |
| --- | --- | --- |
| AFDELING 1 | RISICOFACTOREN | |
| 1.1 | 1. Risicofactoren die van wezenlijk belang zijn voor de effecten die worden aangeboden en/of tot de handel worden toegelaten, moeten op opvallende wijze worden **vermeld** in een afzonderlijke rubriek met als titel „Risicofactoren” om het mogelijk te maken het aan deze effecten verbonden marktrisico in te schatten. 2. In voorkomend geval moet deze rubriek ook een risico**waarschuwing** bevatten om beleggers erop te attenderen dat zij de waarde van hun belegging eventueel geheel of gedeeltelijk kunnen verliezen, naargelang van het geval, en 3. indien de aansprakelijkheid van de belegger verder gaat dan de waarde van zijn belegging, de **vermelding** van dat feit, samen met een **beschrijving** van de omstandigheden waaronder deze aanvullende aansprakelijkheid ontstaat en van de vermoedelijke financiële gevolgen daarvan.   Cat. A | *a ───────*  *b ───────*  *c ───────* |
| *Graag openlaten* | **AFM 1:** | |
| AFDELING 2 | INFORMATIE OVER DE EFFECTEN DIE ZULLEN WORDEN AANGEBODEN/TOT DE HANDEL ZULLEN WORDEN TOEGELATEN | |
| 2.1 | **Informatie** over de effecten | |
| 2.1.1 | Een heldere en uitvoerige uitleg om beleggers te helpen begrijpen hoe de waarde van hun belegging door de waarde van het onderliggende instrument wordt beïnvloed, vooral onder de omstandigheden waarbij de risico’s het grootst zijn,  tenzij de effecten een nominale waarde per eenheid hebben van ten minste 100 000 EUR of alleen tegen betaling van ten minste 100 000 EUR per effect kunnen worden verworven, of alleen mogen worden verhandeld op een gereglementeerde markt of een bepaald segment daarvan, waartoe alleen gekwalificeerde beleggers toegang kunnen krijgen.  Cat. B | ─────── |
| *Graag openlaten* | **AFM 1:** | |
| 2.1.2 | 1. Afloop- of vervaldatum van de derivaten en 2. de uitoefeningsdatum of laatste referentiedatum daarvan.   Cat. C | *a ───────*  *b ───────* |
| *Graag openlaten* | **AFM 1:** | |
| 2.1.3 | **Vermelding** van de afwikkelingsprocedure van de derivaten.  Cat. B | ─────── |
| *Graag openlaten* | **AFM 1:** | |
| 2.1.4 | Een **beschrijving** van:   1. de wijze waarop het rendement op de derivaten tot stand komt; Cat. B 2. betalings- of leveringsdatum; Cat. C 3. de wijze waarop het rendement wordt berekend. Cat. B | *a ───────*  *b ───────*  *c ───────* |
| *Graag openlaten* | **AFM 1:** | |
| 2.2 | **Informatie** over de onderliggende waarde | |
| 2.2.1 | Uitoefenprijs of laatste referentieprijs van de onderliggende waarde.  Cat. C | ───────  *of*  ─────── |
| *Graag openlaten* | **AFM 1:** | |
| 2.2.2 | **Vermelding** van het type onderliggende waarde. Cat. A  **Nadere bijzonderheden** van de plaats waar **informatie** over de onderliggende waarde beschikbaar is, met inbegrip van een **vermelding** van de plaats waar **informatie** over het in het verleden behaalde en toekomstige rendement van de onderliggende waarde en de volatiliteit ervan elektronisch beschikbaar is en of deze gratis beschikbaar is; Cat. C  Wanneer de onderliggende waarde een effect is:   1. naam van de uitgevende instelling van het effect; Cat. C 2. de internationale effectenidentificatiecode („international securities identification number — ISIN”); Cat. C   wanneer de onderliggende waarde een referentie-entiteit of referentieverplichting is (voor credit-linked effecten):   1. wanneer de referentie-entiteit of referentieverplichting bestaat uit één enkele entiteit of op één enkele verplichting, of bij een pool van onderliggende waarden waarbij één enkele referentie-entiteit of referentieverplichting ten minste 20 % van de pool vertegenwoordigt: 2. indien van de referentie-entiteit (of de uitgevende instelling van de referentie­verplichting) nog geen effecten tot de handel op een gereglementeerde of gelijkwaardige markt van een derde land of een mkb-groeimarkt zijn toegelaten, voor zover de uitgevende instelling daarvan op de hoogte is en/of in staat is op te maken uit de door de referentie-entiteit (of de uitgevende instelling van de referentieverplichting) gepubliceerde informatie:   informatie met betrekking tot de referentie-entiteit (of de uitgevende instelling van de referentieverplichting) alsof zij de uitgevende instelling was (overeenkomstig het registratiedocument voor wholesale-effecten zonder aandelenkarakter); Cat. A   1. Indien van de referentie-entiteit (of de uitgevende instelling van de referentie­verplichting) nog geen effecten tot de handel op een gereglementeerde of gelijkwaardige markt van een derde land of een mkb-groeimarkt zijn toegelaten, voor zover de uitgevende instelling daarvan op de hoogte is en/of in staat is op te maken uit de door de referentie-entiteit (of de uitgevende instelling van de referentieverplichting) gepubliceerde informatie:   naam, ISIN, adres, land van oprichting, sector(en) waarin de referentie-entiteit (of de uit­gevende instelling van de referentieverplichting) actief is en naam van de markt waartoe haar effecten zijn toegelaten. Cat. C   1. bij een pool van onderliggende waarden waarbij één enkele referentie-entiteit of referentieverplichting minder dan 20 % van de pool vertegenwoordigt: 2. de namen van de referentie-entiteiten of de uitgevende instellingen van de referentieverplichtingen; Cat. C 3. de ISIN. Cat. C   Wanneer de onderliggende waarde een index is:   1. de naam van de index; Cat. C 2. een **beschrijving** van de index indien deze door de uitgevende instelling of door een tot dezelfde groep behorende juridische entiteit is samengesteld; Cat. A 3. een **beschrijving** van de index die wordt verstrekt door een juridische entiteit of een natuurlijke persoon welke optreedt in samenwerking met of namens de uitgevende instelling, tenzij het prospectus de volgende verklaringen bevat: Cat. B 4. het volledige geheel van regels van de index en de **informatie** over de prestaties van de index zijn vrij toegankelijk op de website van de uitgevende instelling of van de opsteller van de index; 5. de geldende regels (inclusief methodologie van de index voor de selectie en het opnieuw in evenwicht brengen van de componenten van de index, **beschrijving** van marktverstorende gebeurtenissen en aanpassingsregels) zijn op vooraf bepaalde en objectieve criteria gebaseerd.   De punten b) en c) zijn niet van toepassing wanneer de beheerder van de index is opgenomen in het op grond van artikel 36 van Verordening (EU) 2016/1011 ( [[1]](#footnote-1) ) door de ESMA bijgehouden openbare register.     1. Wanneer de index niet door de uitgevende instelling is samengesteld, moet worden **aangegeven** waar **informatie** over de index kan worden verkregen. Cat. C   Wanneer de onderliggende waarde een rentevoet is, een **beschrijving** van de rentevoet. Cat. C  Wanneer de onderliggende waarde niet tot een van de bovengenoemde categorieën behoort, bevat de verrichtingsnota gelijkwaardige informatie. Cat. C  Wanneer de onderliggende waarde een korf van onderliggende waarden is, wordt voor elke onderliggende waarde de bovengenoemde informatie en het respectieve gewicht van elke onderliggende waarde in de korf bekendgemaakt. Cat. C | ───────  ───────  *a ───────*  *b ───────*  *a ───────*  i. ───────    ii. ───────  *b ───────*  i. ───────  ii. ───────  *a ───────*  *b ───────*  *c ───────*  i. ───────  ii. ───────  *d ───────*  ───────  ───────  ─────── |
| *Graag openlaten* | **AFM 1:** | |
| 2.2.3 | **Beschrijving** van enigerlei marktverstorende of afwikkelingsverstorende gebeurtenissen of kredietgebeurtenissen die van invloed zijn op de onderliggende waarde.  Cat. B | ─────── |
| *Graag openlaten* | **AFM 1:** | |
| 2.2.4 | Aanpassingsregels voor gebeurtenissen die van invloed zijn op de onderliggende waarde.  Cat. B | ─────── |
| *Graag openlaten* | **AFM 1:** | |
| AFDELING 3 | AANVULLENDE INFORMATIE | |
| 3.1 | 1. **Vermelding** in het prospectus of de uitgevende instelling al dan niet voornemens is na de uitgifte informatie te verstrekken. 2. Wanneer de uitgevende instelling heeft aangegeven dat zij voornemens is dergelijke informatie te verstrekken, specificeert zij in het prospectus welke informatie zal worden medegedeeld 3. en waar deze kan worden verkregen.   Cat. C | *a ───────*  *b ───────*  *c ───────* |
| *Graag openlaten* | **AFM 1:** | |

-= Einde van verwijzingstabel =-

1. Verordening (EU) 2016/1011 van het Europees Parlement en de Raad van 8 juni 2016 betreffende indices die worden gebruikt als benchmarks voor financiële instrumenten en financiële overeenkomsten of om de prestatie van beleggingsfondsen te meten en tot wijziging van Richtlijnen 2008/48/EG en 2014/17/EU en Verordening (EU) nr. 596/2014 (PB L 171 van 29.6.2016, blz. 1). [↑](#footnote-ref-1)