

Syfte

Detta faktablad ger dig basfakta om denna investeringsprodukt. Det är inte reklammaterial. Informationen krävs enligt lag för att hjälpa dig att förstå produktens egenskaper, risker, kostnader, möjliga vinster och förluster och för att hjälpa dig att jämföra den med andra produkter. Detta dokument beskriver de allmänna riskerna med en PRIIP, som du kanske överväger som en finansiell investering, för jämförelse med andra produkter. De särskilda villkoren för produkten som du anger kommer att visas i bekräftelsen i jämförelse med den produkten.

Produkt

Produktens namn:	OTC - Swaption.
PRIIP-produktutvecklarens namn:	Danske Bank A/S - www.danskebank.dk .
Kontakt information:	Ring +45 45 14 72 31 för mer information.
Behörig myndighet:	Den danska finansinspektionen är ansvarig för tillsynen av Danske Bank vad gäller detta faktablad.
Medlemsstat:	Denna Priip är auktoriserad i Danmark.
Produktionsdatum:	Datum för faktabladet är 12. januari 2024

Varning: Du står i begrepp att köpa en produkt som inte är enkel och som kan vara svår att förstå.

Vad innebär produkten?

Typ
OTC - Swaption

Löptid

Förfallodagen för en swaption inträffar den dag i framtiden som du vill att den underliggande ränteswappen, om den utnyttjas, ska börja. En swaption är ett bilateralt avtal som normalt inte kan sägas upp ensidigt, varken av dig eller av Danske Bank.

Mål

Målet med denna produkt är att antingen

1. ha rätt (om du köper produkten och betalar en premie) att ingå en ränteswap för att säkra en underliggande tillgång eller skuld genom att regelbundet byta fast mot rörlig räntebetalning från startdatum till slutdatum.
2. vara skyldig (om du säljer produkten och erhåller en premie) att ingå en ränteswap för att byta räntebetalningarna på en underliggande tillgång eller skuld genom att regelbundet byta fast mot rörlig räntebetalning från startdatum till slutdatum.

Målet uppnås genom att (1) Danske Bank överenskommer om villkoren för en swaption med dig och 2) du samtycker till att betala eller erhålla en fast premie till/från Danske Bank. Premien regleras i samband med att du handlar en swaption.

Köparen utnyttjar sin swaption om den fasta räntan på den underliggande ränteswappen är förmånligare för köparen än den rådande marknadsräntan på förfallodagen för en swaption.

Villkoren nedan är exempel på villkoren för en swaption, men inte de exakta villkoren som du samtycker till med Danske Bank. De exakta villkoren anges i varje enskilt bekräftelsebrev.

De beskrivande villkoren används för efterföljande resultatscenarier och kostnadsberäkning.

Produktvillkoren föreskriver att om vissa extraordinära händelser inträffar får (1) Danske Bank justera produkten och/eller (2) Danske Bank eller du säga upp produkten i förtid. De extraordinära händelserna i fråga anges i produktvillkoren och rör främst det underliggande, produkten och villkor som gäller för dig eller Danske Bank. Den avkastning som du (eventuellt) får vid en förtida uppsägning avviker sannolikt från den som du hade fått vid de scenarier som beskrivs ovan.

Detaljer - swaption

Köpare:	Kund
Aviseringsdag:	Förfallodag - 2 dagar
Förfallodag:	1 dag + 1 år
Strike:	ATMF
Premie:	EUR 353,00

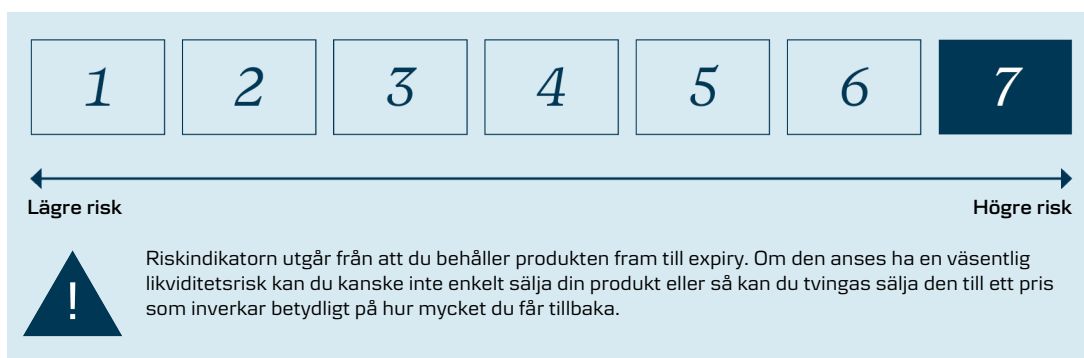
Detaljer - underliggande swap

Startdatum:	Förfallodag
Slutdatum:	Startdatum + 10 år
Du betalar:	Fast ränta, 30/360 årligen
Du får:	Euribor 6 månader
Valuta:	EUR
Nominellt:	10.000,00
Tidsplan:	Bullet

Målgrupp

Den här produkten är avsedd för danska privatinvestorer som vill ha rätt (för en köpt swaption) att säkra en underliggande ränterisk eller (för en såld swaption) att kunna eventuellt ändra räntebetalningarna på en underliggande tillgång eller skuld. Köparen av en swaption meddelar säljaren på aviseringsdagen.

Vilka är riskerna och vad kan jag få för avkastning?



Riskindikator

Den sammanfattande riskindikatorn ger en vägledning om risknivån för denna produkt jämfört med andra produkter. Den visar hur troligt det är att produkten kommer att sjunka i värde på grund av marknadsutvecklingen eller på grund av att vi inte kan betala dig.

Vi har klassificerat produkten som 7 av 7, dvs. den högsta riskklassen. Denna produkt innehåller inte något skydd mot framtida marknadsresultat. Du kan därför förlora hela eller delar av din investering. Om vi inte kan betala dig vad vi är skyldiga kan du förlora hela din investering.

Resultatscenarier

I siffrorna ingår alla kostnader för själva produkten, men eventuellt inte alla kostnader som du betalar till din rådgivare eller distributör. I siffrorna tas ingen hänsyn till din personliga beskattningssituation, som också kan påverka hur mycket du får tillbaka.

Vad du får från denna produkt beror på framtida marknadsresultat. Den framtida marknadsutvecklingen är osäker och kan inte förutsägas exakt.

De scenarier som visas bygger på tidigare resultat och på vissa antaganden. Marknaderna kan utvecklas helt annorlunda i framtiden.

Stressscenariet visar vad du kan få tillbaka under extrema marknadsförhållanden och tar inte hänsyn till en situation där vi inte kan göra utbetalningar till dig.

De positiva, neutrala och negativa scenarierna är beräknade med hjälp av en modell som genererar möjliga framtida resultat baserat på de underliggande tillgångarnas tidigare utveckling och resresenterar var för sig 90:e, 50:e och 10:e bästa resultat. Stressscenariet visar vad du kan få tillbaka under extrema marknadsförhållanden.

Rekommenderad innehavstid:		1 år
Exempel på investering:		EUR 10.000,00
		Om du löser in efter rekommenderad innehavstid
Scenarier		
Minimum	There is no minimum guaranteed return. You could lose some or all of your investment.	
Stress	Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader	EUR -268,33
	Genomsnittlig avkastning per år	-5,92%
Negativt	Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader	EUR -29,39
	Genomsnittlig avkastning per år	-3,53%
Neutralt	Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader	EUR -29,39
	Genomsnittlig avkastning per år	-3,53%
Positivt	Vad du kan få tillbaka efter avdrag för kostnader	EUR 767,20
	Genomsnittlig avkastning per år	4,44%

Vad händer om Danske Bank inte kan göra några utbetalningar?

Denna produkt är inte skyddad av den danska garantifonden eller genom någon annan ersättning till investerare eller annan garanti. Det innebär att om Danske Bank inte kan betala, kan du förlora alla dina förväntade betalningar.

Vilka är kostnaderna?

Vidare kan du bli tvungen att skicka säkerheter i form av tillgångar till den motpart som rådgivit eller sålt produkten, för att säkerställa produktens exponering. Motparten är ej nödvändigtvis tvingad att returnera dessa tillgångar till dig.

Kostnader över tid

Tabellerna visar de belopp som tas från din investering för att täcka olika typer av kostnader. Beloppens storlek beror på hur mycket du investerar, hur länge du innehar produkten. Beloppen som visas här är baserade på ett exempel på investeringsbelopp och olika möjliga investeringsperioder.

Vi har antagit följande:

- Det första året får du tillbaka det belopp som du investerat (0% årlig avkastning). För de andra innehavstiderna har vi antagit att produkten presterar i enlighet med vad som visas i det neutrala scenariot.
 - EUR 10.000,00. investeras.

	<i>Om du löser in efter 1 år</i>
Totala kostnader	EUR 29,39
Kostnadseffekter (*) (**)	0,29%

(*) Detta visar kostnadseffekten för en innehavstid på mindre än ett år. Procentsatsen är inte direkt jämförbar med de siffror för kostnadseffekt som lämnas för andra Priip-produkter.

(**) Detta visar kostnader i förhållande till Priip produktens nominella värde.

Som ersättning för sina tjänster kan personen som säljer produkten till dig komma att erhålla en del av de kostnader som du betalar till oss. Du kommer att få information om beloppet.

Kostnadssammansättning

Engångskostnad vid teckning eller inlösen		Om du löser in efter ett år
Teckningskostnad	0,29% av det belopp du betalar.	EUR 29,39
Inlösenkostnad	0,00% av din investering, innan den betalas ut till dig.	EUR 0,00
Löpande kostnader		
Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader	Inga sådana kostnader finns för denna produkt.	EUR 0,00
Transaktionskostnader	Inga transaktionskostnader finns för denna produkt.	EUR 0,00
Extra kostnader som tas ut under särskilda omständigheter		
Resultatrelaterade avgifter	Ingen resultatrelaterad avgift tas ut för denna produkt.	EUR 0,00

Kostnaden för denna produkt är baserad på den faktiskt känsligheten för räntor och dess volatilitet. Faktiska kostnaderna kommer att bero på kredit-, finansierings- och kapital kostnaderna.

Dessa kostnader är kunds specifika and kan inte specificeras innan produkten är prisad mot en viss kund.

Hur länge bör jag behålla produkten och kan jag ta ut pengar i förtid?

Denna produkt är avsedd att behållas till förfallodagen och är inte en produkt som enkelt kan säljas eller överlåtas. Förtida uppsägning är möjlig vid uteblivna utbetalningar eller avbrott i utbetalningarna, eller om du och Danske Bank kommer överens om förtida uppsägning. I sådana fall kan straffavgifter för förtida avslutning komma att tillämpas.

Hur kan jag klaga?

Klagomål på den här produkten, Danske Bank agerande och/eller på den person som ger råd om eller säljer produkten till dig, bör riktas till Danske Bank, Juridisk Afdeling, Holmens Kanal 2-12, 1092 København K (klageservice@danskebank.dk).

Övrig relevant information

De risker som beskrivs i detta dokument beskriver vissa risker, men inte alla, med att investera i denna produkt. Innan du fattar beslut om en investering bör du förvissa dig om att du helt förstår de risker som finns med denna produkt och söka professionell hjälp om du behöver det. De fullständiga villkoren för produkten anges i de allmänna villkoren för handel med produkten och i bekräftelsen för den handlade specifika produkten, kompletterad och ändrat från tid till annan.