

CMC MARKETS TIERED WEIGHT AKTIEKORG METHODOLOGY

BESKRIVNING AV AKTIEKORG

1. Definitioner:

“**Aktiekorg**” avser CMC Markets aktiekorg;

“**Aktiekorgskomponent**” avser en av de aktier som är med att skapa ett Aktiekorgspris;

“**Aktiekorgspris**” avser priset för en Aktiekorg;

“**CMC Markets**” avser CMC Markets UK plc, CMC Spreadbet plc och CMC Markets Germany GmbH (med registreringsnummer 02448409, 02589529 och HRB 114199);

“**Förändrat Delningstal**” avser en förändring av Delningstal för Aktiekorg på grund av en Störande Händelse för Aktiekorg;

“**Initialt Aktiekorgsvärde**” avser Aktiekorgspris på Lanseringsdagen för Aktiekorgen beräknad enligt sektion 3;

“**Utgående Komponent**” avser den Aktiekorgskomponent, som substitueras med en annan Aktiekorgskomponent som ett resultat av en Ersättningshändelse;

“**Prisjustering**” avser en justering av pris för en Aktiekorgskomponent och därmed till Aktiekorgspris som ett resultat av en Störande Händelse för Aktiekorg;

“**Kvalificerad komponent**” avser en komponent som röstats fram för inkludering i Aktiekorg av Revideringskommittén för Aktiekorgen;

“**Ombalanseringsdag**” avser den första Handelsdagen i månaden efter en Revideringsdag;

“**Revideringsdag**” avser den tredje fredagen i mars, juni, september och december från och med 2019 eller annan dag om Revideringskommittén för Aktiekorgar så beslutar;

“**Störande Händelse för Aktiekorg**” avser bland annat dagar då börserna håller stängt och/eller då någon av Aktiekorgskomponenterna inte handlar enligt ordinarie handelstider;

“**Delningstal för Aktiekorg**” avser det delningstal som användes för Initialt Aktiekorgsvärde vid starten av en Aktiekorg;

“**Lanseringsdag för Aktiekorg**”, avser den dag då Aktiekorgen prissattes för första gången och när basvärdet bestämdes. Se “Ytterligare information” för mer information om basvärdet;

“**Ombalansering av Aktiekorg**” avser den förändring av en Aktiekorg som sker efter ett möte som hålls av Revideringskommittén för Aktiekorgar.

“**Revideringskommittén för Aktiekorgar**” avser den kommitté som reviderar sammansättningen av en Aktiekorg. Detta sker Revideringsdagen eller mer ofta om de så beslutar. Kommittén består

av tre CMC Markets-medarbetare och utnämns och tillsätts av personen som är ansvarig för avdelningen "Trading" vid CMC Markets kontor i London (133 Houndsditch, London, EC3A 7BX);

"Ersättningshändelse" avser ett utbyte av en Aktiekorgskomponent som ett resultat av en Störande Händelse för Aktiekorg;

"Handelsdag" avser en dag då alla marknader för Aktiekorgskomponenten annat än en dag då handeln på en sådan relevant börs är planerat att stängas före dess vanliga stängningstid: och

"Förändrat Antal" avser en förändring av det antal enheter en Aktiekorgskomponent består av på grund av en Störande Händelse för Aktiekorg.

2. Initial Aktiekorg sammansättning och minsta antal Aktiekorgskomponenter

Vid Lanseringsdagen för Aktiekorg kommer varje Aktiekorg bestå av Aktiekorgskomponenterna i tabell 7.1 till 7.17 som anses vara lämpliga för inkludering av Revideringskommittén för Aktiekorgar. Alla korgar kommer att ha samma viktning.

Med målet att nå det Initiala Aktiekorgsvärdet på 20 000 000 i någon av följande valutor USD, CAD, EUR, GBP bestäms sedan viktningen för fördelningen av det Initiala Aktiekorgsvärdet för respektive Aktiekorgskomponent. Detta kommer sedan att avgöra hur många enheter av respektive Aktiekorgskomponent baserat på stängningskursen på Lanseringsdag för Aktiekorg.

Antalet enheter för respektive Aktiekorgskomponent avrundas sedan till tre decimaler vilket kan skapa en diskrepans mot målet Initialt Aktiekorgsvärde. Se sektionen "Ytterligare information" för uppgifter om Aktiekorgskomponenter, viktningar samt avrundningsfel.

Varje Aktiekorg kommer till en början samt efter varje Ombalansering av respektive Aktiekorg, bestå av det antalet Aktiekorgskomponenter som listas i tabellerna 7.1 till 7.17 (sektion 7), men det kan komma att revideras om de är färre än det antal Aktiekorgskomponenter som listas i respektive tabell, på grund av en Störande Händelse för Aktiekorg.

Mellan en Ombalansering av Aktiekorg, kan en Aktiekorgskomponent tas bort från Aktiekorg på grund av Störande Händelse för Aktiekorgs såsom bland annat insolvens eller avstängning.

3. Initialt Aktiekorgsvärde och beräkningsmetodik

Värdet av en Aktiekorg kommer att ha ett Initialt Aktiekorgsvärde av 20.000.000 i den underliggande valutan för aktierna (se nedan).

$$IV_{(0)} = \sum_{i=1}^n X_{(i,0)} * P_{(i,0)}$$

Där:

$IV_{(0)}$ = Initialt Aktiekorgsvärde on Handelsdag $t=0$

$X_{(i,0)}$ = Number of units of Komponent i in the Aktiekorg after cap and floor rules have been applied

$P_{(i,0)}$ = Price of Komponent i in the Aktiekorg on Handelsdag $t=0$

n = Number of components in the Aktiekorg on Handelsdag $t=0$

Aktiekorgspris kommer sedan att beräknas med följande formell:

$$IP_{(s)} = \frac{\sum_{i=1}^n X_{(i,t)} * P_{(i,s)}}{D_{(t)}}$$

Där:

$IP_{(s)}$ = Nuvarande Aktiekorgspris vid tidpunkten **s**

$P_{(i,s)}$ = Senaste publicerat CMC Markets köp- eller säljpris för komponent **i** vid tidpunkten **s**

n = Antal komponenter i Aktiekorgen vid Handelsdag **t**

$X_{(i,t)}$ = Antal enheter i Aktiekorgen av komponenten **i** vid Handelsdag **t** efter att reglerna för tak och golv har implementerats

$D_{(t)}$ = Delningstal för Aktiekorgen på Handelsdag **t**

Om det förväntas ske en värdeförändring för Aktiekorgen på grund av en icke-marknadsdriven händelse i förhållande till någon av Aktiekorgskomponenterna, kommer ett Delningstal för Aktiekorgen beräknas baserat på stängningskursen, för respektive Aktiekorgskomponent, dagen före den förväntade händelsen för att bibehålla ett konsekvent Aktiekorgspris.

4. Störande Händelse för Aktiekorg

Om Revideringskommittén för Aktiekorgar beslutar att det har inträffat en Störande Händelse för Aktiekorg, kommer Revideringskommittén för Aktiekorgar besluta om de kommer att ta bort eller bibehålla Aktiekorgskomponenten i Aktiekorgen. En Störande Händelse för Aktiekorg kan komma att klassificeras som företagshändelse och i dessa fall kan speciella åtgärder vidtas, efter Revideringskommittén för Aktiekorgars eget gottfinnande, för att justera Aktiekorgen. Företagshändelser och hur dessa kan hanteras listas nedan. I de fall som inte är en företagshändelse kommer ett nytt Delningstal för Aktiekorgen att beräknas för den påverkade Aktiekorgskomponenten Beräkningen sker baserat på det senaste priset före den Störande Händelsen för Aktiekorgen.

Företagshändelser

Företagshändelser kan resultera i antingen en Prisjustering, ett Förändrat Antal, och/eller ett Förändrat Delningstal.

Följande Företagshändelser och hur de troligen kommer att behandlas listas nedan:

	Företagshändelse	Beskrivning	Justering
1	Utdelning	Ordinarie utdelning	Prisjustering
2	Utdelning	Extrautdelning	Prisjustering
3	Utdelning	Optional Utdelning/DRIP/SCRIP	Prisjustering
4	Utdelning	Fondemission/Utdelning av aktier	Förändrat Antal & Förändrat Delningstal
5	Capital Change	Stock Split/Subdivision	Förändrat Antal
6	Capital Change	Omvänd split	Förändrat Antal

7	Capital Change	Share Redenomination	Förändrat Delningstal
8	Sammanlagning & förvärv	Sammanlagning	Förändrat Delningstal
9	Sammanlagning & förvärv	Acquisition/Takeover	Förändrat Delningstal
10	Sammanlagning & förvärv	De-merger/Spin-Off	Förändrat Delningstal
11	Exceptional Market Condition	Bankruptcy/Suspension	Förändrat Delningstal
12	Exceptional Market Condition	Ändrad listning	Förändrat Delningstal
13	Exceptional Market Condition	Share Conversion	Förändrat Delningstal
14	Capital Increase	Nyemission	Förändrat Delningstal
15	Capital Increase	Capital Return/Capital Repayment	Prisjustering
16	Capital Increase	Aktieåterköp/Tender Offer	N/A

Specifikationer på olika företagshändelser

i. Ordinarie utdelning (Prisjustering)

Utdelningar är kontantutbetalningar till aktieägarna av företagets vinster. Detta sker vanligen genom återkommande utbetalningar med en viss periodicitet såsom kvartalsvis, två gånger per år eller årligen.

Påverkan på Aktiekorg:

Ordinarie utdelning kommer att innebära en Prisjustering i Aktiekorgen.

Vid avskiljningen av utdelningen kommer aktiepriset för Aktiekorgskomponenten att minska ungefär motsvarande bruttobeloppet för den ordinarie utdelningen. Detta kommer att resultera i en motsvarande justering av Aktiekorgspriset baserat på hur stor viktning den påverkade Aktiekorgskomponenten har.

Det kommer sedan att ske en kontantjustering till innehavaren av Aktiekorgen motsvarande nettobeloppet för den ordinarie utdelningen.

ii. Extrautdelning (Prisjustering)

Extrautdelningar är utdelningar som betalas utanför den ordinarie periodiciteten för den ordinarie utdelningen. Dessa brukar vara engångsutbetalningar då bolaget sitter på överskottskapital t.ex. efter att de har sålt av en tillgång.

Påverkan på Aktiekorg:

Extrautdelningar kommer att innebära en Prisjustering i Aktiekorgen.

Vid avskiljningen av utdelningen kommer aktiepriset för Aktiekorgskomponenten att sjunka ungefär motsvarande bruttobeloppet för utdelningen. Detta kommer att resultera i en motsvarande justering av Aktiekorgspriset baserat på hur stor viktning den påverkade Aktiekorgskomponenten har.

Det kommer sedan att ske en kontantjustering till innehavaren av Aktiekorgen motsvarande nettobeloppet för utdelningen.

iii. DRIPs & SCRIPs (Optional Utdelnings) (Prisjustering)

Dividend Reinvestment Plans (“**DRIPs**”) och SCRIP Dividend Schemes (“**SCRIPs**”) är Optional Utdelning händelser som gör det möjligt för aktieägarna att välja mellan att få sina Ordinarie utdelnings i form av en kontant Utdelning-betalning eller alternativt återinvestera kontant utdelning tillbaka till aktier i det företag som Utdelning härstammar från, med aktieägarna då erhåller nya aktier i stället för kontant utbetalning.

Påverkan på Aktiekorg:

Ett Optional Utdelning Event kommer att behandlas på samma sätt som en Ordinarie Utdelning och kommer därmed att resultera i en Prisjustering för Aktiekorgen. På ex-dagen kommer priset för Aktiekorgskomponenten att sjunka ungefär motsvarande bruttobeloppet för utdelningen. Detta kommer att resultera i en lika stor justering av Aktiekorgspriset baserat på Aktiekorgskomponentens genomsnittliga viktning. Det kommer sedan att ske en kontantjustering till innehavaren av Aktiekorgen motsvarande nettobeloppet för värdet av utdelningen.

iv. Fondemission/Utdelning av Aktier (Förändrat Antal & Förändrat Delningstal)

En “**Fondemission**” är när aktieägaren tilldelas aktier istället för att få **kontant** utdelning. Normalt sett tilldelas aktieägaren aktier av samma aktieslag men det händer även att man tilldelas andra aktieslag.

Påverkan på Aktiekorg:

I de fall som man erhåller aktier av ett annat aktieslag kommer fondemission att behandlas som en Ordinarie Kontant Utdelning. I alla andra fall kommer det att ske en justering på ex-dagen av antalet enheter som Aktiekorgskomponent representerar med det förhållande som tillhandahålls i villkoren för et Fondemission. Detta vil påverkat som en avräkning med minskningen av värdet på aktiekorgskomponenten och kräver en divisorjustering för att upprätthålla aktiekorg priset.

En “**Utdelning av Aktier**” liknar en Fondemission och båda behandlas på samma vis.

v. Stock Split/Subdivision (Förändrat Antal)

En “**Stock Split/Subdivision**” innebär en ökning av antalet utestående aktier och därmed en reducerad aktiekurs i motsvarande grad då marknadsvärdet för bolaget är oförändrat.

Påverkan på Aktiekorg:

På ex-datum kommer antalet enheter i Aktiekorgskomponenten att öka med den angivna multiplikatorn, vilket kompenserar minskningen av den ingående aktiekursen. Detta kommer att resultera i ingen ändring av Aktiekorgspriset.

vi. Omvänd split (Förändrat Antal)

En “**Omvänd split**” innebär att antalet utestående aktier minskar på marknaden och detta leder till en ökad aktiekurs eftersom att bolagets marknadsvärde är oförändrat.

Påverkan på Aktiekorg:

På ex-datum kommer antalet enheter för Aktiekorgskomponenter att minska med en bestämd multiplikator, samtidigt kommer aktiekursen att stiga i motsvarande grad. Detta innebär att det inte blir någon förändring Aktiekorgspriset.

vii. Redenominering (Förändrat Delningstal)

En redenominering är när en aktie börjar handlas i en annan valuta.

Påverkan på Aktiekorg:

Vid en redenominering kommer Aktiekorgskomponenten att tas bort från Aktiekorgen till dess senaste tillgängliga pris. Delningstalet för Aktiekorgen kommer sedan att justeras för att bibehålla samma Aktiekorgspris.

viii. Sammanslagning (Förändrat Delningstal)

En sammanslagning är när två bolag slås samman och formar ett nytt bolag. De tidigare bolagen upphör att existera som två separata enheter.

Påverkan på Aktiekorg:

På dagen för sammanslagningen kommer de existerande bolagen att tas bort från Aktiekorgen till deras senaste kurs. Det nya bolaget kommer att läggas till. Antalet enheter i det nya företaget och ingångspriset kommer att bero på förhållandet mellan gammalt och nytt, till exempel:

Bolag A slås samman med Bolag B och formar Bolag C
Bolag A består av 100 000 aktier som handlas till USD 10
Bolag B består av 100 000 aktier som handlas till USD 5
Andel av Bolag A i Bolag C är 67%
Andel av Bolag B i Bolag C är 33%
Bolag C kommer bestå av 100 000 enheter som handlas till USD 15

Om både Bolag A och Bolag B är Aktiekorgskomponenter i Aktiekorgen kommer det inte att vara någon förändring av Delningstalet för Aktiekorgen eftersom att marknadsvärdet för sammanslagna bolaget kommer att vara det samma som de tidigare bolagen.

Om bara ett av bolagen är en Aktiekorgskomponent i Aktiekorgen, kommer antingen:

- Aktiekorgskomponenten att tas bort till sitt senaste handlade pris och Delningstalet för Aktiekorgen kommer att justeras för att bibehålla samma Aktiekorgspris; eller
- Aktiekorgskomponenten att tas bort till sitt senaste handlade pris och det nya bolaget kommer att läggas till. Kursen för det nya bolaget kommer att baseras på de priser som var de senaste kurserna för de sammanslagna bolagen. Delningstalet för Aktiekorgen kommer sedan att justeras för att bibehålla samma Aktiekorgspris (detta är nödvändigt eftersom att det nya bolaget kommer att ha ett högre marknadsvärde än det bolag som tidigare var en Aktiekomponent).

ix. Förvärv (Förändrat Delningstal)

Ett "Förvärv" är när ett bolag (förvärvaren) köper samtliga aktier i ett annat bolag. Villkoren för övertagandet kan vara 100% kontantbetalning, då befintliga aktieägare i företaget som förvärvas kommer att få en kontantbetalning i stället för deras aktieinnehav, eller 100% betalning i aktier då befintliga aktieägare kommer att få nya aktier i förvärvaren istället för deras aktieinnehav. Det kan också vara en blandning av både kontanter och aktier.

Påverkan på Aktiekorg:

Om förvärvet sker med kontanter till 100% kommer bolaget att tas bort från Aktiekorgen till ett kontantbudande pris. Delningstalet för Aktiekorgen kommer sedan att justeras för att bibehålla Aktiekorgspriset.

Om förvärvet sker med betalning i aktier till 100% kommer bolaget att tas bort till motsvarande värde för en ny aktie i förvärvaren baserat på villkoren för erbjudandet.

Om förvärvaren redan är en Aktiekorgskomponent kommer antalet enheter för förvärvaren att öka med förhållandet mellan nya aktier som ges till målaktieägarna. Delningstal för Aktiekorg kommer sedan att justeras för att bibehålla Aktiekorgspriset.

Om förvärvaren inte redan är en beståndsdel i Aktiekorget, sedan kan det läggas till i Aktiekorget till det sista noterade priset och Delningstal för Aktiekorg kommer att justeras för att bibehålla Aktiekorgspriset.

Om det bestäms förvärvaren ska inte läggas till Aktiekorg, vil Delningstal för Aktiekorg bli justerad för att bibehålla Aktiekorgspriset.

Om förvärvet är del aktier och delkontanter, kommer målet att avlägsnas till motsvarande värde på både kontant- och aktievillkor. Förvärvaren läggs sedan till det sist noterade priset om det inte redan är en Aktiekorgskomponent. Delningstal för Aktiekorg kommer sedan att justeras för att bibehålla Aktiekorgspriset.

x. Demerger/Spin-Off (Förändrat Delningstal)

Ett **“Demerger/Spin-Off”** är när ett bolag delar en del av sin verksamhet för att bli en fristående enhet.

Påverkan på Aktiekorg:

Med ett Demerger/Spin-Off vil priset på det originalet Aktiekorgskomponent minska med värdet på demerged/spun-off bolaget på relevanta dato.

Den Demerger /Spin-Off-linjen läggs sedan till Aktiekorg till det teoretiska värdet baserat på villkoren för Demerger / Spin-off. Ingen förändrat Delningstal krävs eftersom det kombinerade marknadskapitalet för både den ursprungliga beståndsdel och den nya beståndsdel bör vara lika med det förjusterade marknadskapitalet. Om det bestäms att demerged/spun-off-linjen inte kommer att läggas till i korgen, vil Delningstal för Aktiekorg bli justerad för att bibehålla Aktiekorgspriset.

xi. Bankruptcy/Suspension (Förändrat Delningstal)

Företag kan avbrytas från handel av flera orsaker, men vanligtvis uppstår de när det finns allvarlig oro för ett företags tillgångar eller verksamhet. Dessa upphängningar kan ibland leda till långtidsstopp och / eller konkursförfaranden.

Påverkan på Aktiekorg:

Om Aktiekorgskomponent er suspenderade vil hela Aktiekorg bli suspenderat tills orsaken till suspensionen kan fastställas. Om orsaken inte kan fastställas inom en rimlig tidsram (cirka 5 arbetsdagar) eller om företaget bedöms gå in i ett långsiktigt upphävande eller konkursförfarande, kommer den suspenderande Aktiekorgskomponenten att tas bort från Aktiekorg till sist noterade priset. En aktieposition i den suspenderande beståndsdel kommer att öppnas vid sidan av Aktiekorg för det motsvarande värdet av exponeringen för den relevanta beståndsdel inom Aktiekorg baserat på det vägda genomsnittet.

Kundens positionsstorlek på Aktiekorg kommer att minska för att återspegla exponeringsökningen orsakad av den nya aktiepositionen, till exempel:

En kund har en position på 10 enheter i en Aktiekorg-handel till 2 000,00 USD (total exponering 20 000,00 USD)

En beståndsdel i korgen med en 20% viktning suspenderad och avlägsnas därefter från korgen, varvid denna beståndsdel motsvarar en exponering på 4 000,00 USD $((10 \times 2\,000,00) \times 0,20)$. Därför öppnas en ny position i underliggande kapitalet till det senaste noterade priset för en total exponering på 4 000,00 USD. Aktiekorgs indexposition reduceras sedan till 8 enheter till 2 000,00 USD (total exponering 16 000,00 USD).

Den nya aktiepositionen kommer att erhålla säkerhetskravet för det underliggande instrumentet som redan fastställts av CMC Markets. Vid konkursförfarande kommer CMC Markets att använda rimliga ansträngningar för att ge kunder 24 timmars varsel om att marginet (säkerhetskravet) kommer att öka till 100%. I dessa fall förblir både korg och kapitalpositionen suspenderad till marginalökningen är klar.

xii. Change of Listing (Förändrat Delningstal)

Ett "**Change of Listing**" avser ett företag som flyttar från en börs till ett annat.

Påverkan på Aktiekorg:

I dessa fall kommer det att bestämmas av Revideringskommittén för Aktiekorgar huruvida företaget kan förbli ett Aktiekorgskomponent.

Om det fastställs att beståndsdelarna måste tas bort kommer den att slutföras till det sista noterade priset. Delningstal för Aktiekorg kommer att justeras och beståndsdelarna re-balanseras för att behålla samma Aktiekorgspris.

xiii. Share Conversion (Förändrat Delningstal)

Ett "**Share Conversion**" innebär utbyta av en form av säkerhet mot en annan, till exempel föredragen lager till vanligt lager.

Påverkan på Aktiekorg:

Om det är ett obligatorisk Share Conversion kommer den befintliga beståndsdelarna att tas bort till det sist noterade priset. Om det fastställs att den nya linjen ska läggas till Aktiekorg görs detta till det sista tillgängliga angivna priset. Delningstal för Aktiekorg kommer inte att justeras eftersom marknadskapitalet kommer att förbli oförändrat.

Om det fastställs att den nya linjen inte ska läggas till Aktiekorg, kommer Delningstal för Aktiekorg att justeras och viktningarna balanseras för att bibehålla Aktiekorgspriset.

xiv. Nyemission

En Nyemission är en kapitalinsamling för att kapitalet ökas när befintliga aktieägare ges rätt att köpa en ytterligare aktie i det befintliga företaget till en rabatt till aktuella marknadspriset.

Påverkan på Aktiekorg:

På ex-dagen för Nyemission kommer antalet enheter i Aktiekorgskomponenten att öka

med villkoren för nyemission, detta resulterar i ett förändrat delningstal då marknad kapitalet kommer att ha ökat. Om rättigheterna fastställs som "out of the money" kommer inga åtgärder att vidtas.

xv. Capital Return/Capital Repayment (Prisjustering)

En "**Capital Return/Capital Repayment**" är en betalning av kapital tillbaka till aktieägaren. Detta är vanligtvis resultatet av att företaget har ett överskottskapital och normalt är skattefritt.

Påverkan på Aktiekorg:

På ex-dagen för Capital Return/Capital Repayments, kommer priset på Aktiekorgskomponent att minska med ungefärligt värde på bruttoavkastningen / återbetalningen. Detta resulterar i en motsvarande prisminskning till Aktiekorgspris baserat på det viktade genomsnittet för Aktiekorgskomponenten. En kontantjustering kommer sedan att göras till innehavaren av Aktiekorg för retur / återbetalningsbeloppet (detta är troligtvis bruttovärdet).

xvi. Aktieåterköp/Tender Offer

En "**Aktieåterköp/Tender Offer**" innebär att företaget återköper sina egna aktier från aktieägarna. Share Buy-Backs är ofta obligatoriskt, medan Tender Offers tenderar att vara frivilliga med aktieägare som väljer att sälja sitt innehav tillbaka till företaget. Båda är vanligtvis till ett förutbestämt pris.

Påverkan på Aktiekorg:

Aktieåterköp/Tender Offers kommer inte att ha någon inverkan på Aktiekorgskomponenten eller Aktiekorg.

5. Kvartalsvis revidering av Aktiekorg

Varje Aktiekorg ska revideras av Revideringskommittén för Aktiekorgar vid varje Revideringsdag. På Revideringsdagen kommer alla Aktiekorgskomponenter att återfå samma viktning som tidigare. Alla Aktiekorgskomponenter som överskrider den övre gränsen eller som underskrider den nedre gränsen ska återviktas enligt metoden på Lanseringsdag för Aktiekorg och ett nytt antal enheter per Aktiekorgskomponent beräknas.

På Ombalanseringsdagen ska ett nytt Delningstal beräknas för Aktiekorgen. Grunden för rebalanseringen ska vara de respektive priser på Aktiekorgskomponenter på relevant Ombalanseringsdag, varvid värdet av Aktiekorg efter Ombalanseringsdagen ska vara samma som Aktiekorgspriset som före Ombalanseringsdagen.

Om Revideringskommittén för Aktiekorgar finner att det har skett en Störande Händelse för Aktiekorg på en Ombalanseringsdag, ska Ombalanseringsdag senareläggas till nästkommande Handelsdag som Revideringskommittén för Aktiekorgar bedömer inte är en Störande Händelse för Aktiekorg.

6. Aktiekorgskomponent Substitution

Vår Revideringskommitté för Aktiekorgar gör en bedömning om respektive Aktiekorgskomponenter fortfarande är en Kvalificerad komponent vid varje Revideringsdag. Om det uppstår ett Ersättningshändelse kommer Revideringskommittén för Aktiekorgar att ersätta Utgående Komponent med en nytt Aktiekorgskomponent på Ombalanseringsdag.

Om det inte finns någon Kvalificerad komponent kommer vikten (värdet) av den Utgående Komponent att distribueras proportionellt till de återstående Aktiekorgskomponenter.

Grunden för utbyte ska vara priserna för Aktiekorgskomponenter på Ombalanseringsdag.

7. Ytterligare information

För ytterligare information om viktning, kontakta kundservice@cmcmarkets.se.