

Statusrapport för Danske Bank DDBO 405 Kreditindexbevis

SE0006504445

Värderingsdatum: 2019-09-30

Korta fakta

Beskrivning	Danske Bank DDBO 405 Kreditindexbevis är en icke kapitalskyddad placering med en löptid om ca 5 år. Investeringen erhåller en årlig kupong om 6,01 %, genom att ta på sig kreditrisken i det underliggande Referensindexet, som består av 75 europeiska bolag med kreditrating under Investment Grade. Kupongen betalas ut årsvis och beräknas på Utestående nominellt belopp. Utestående nominellt belopp reduceras med 1/75 av nominellt belopp för varje kredithändelse som inträffar bland de 75 bolagen.
Valuta	SEK
Emissionskurs	100 % av nominellt belopp
Kapitalskydd	Nej
Kupong	6,01 % av nominellt belopp
Ränteberekningsperiod	Från den 2015-01-02 t.o.m den 2019-12-20.
Datum Kupongutbetalning (Ränteförfallodagar)	20:e december 2015-2020 (totalt 5 kuponger)
Kreditriskperiod	Från 2014-12-16 till och med 2019-12-20
Likviddag	2 januari 2015
Återbetalningsdag	20 januari 2020

Kreditindex

Namn	Vikt
iTraxx Europe Crossover 22*	100 %

* För underliggande bolag se Bilaga A.

Statusrapport för Danske Bank DDBO 405 Kreditindexbevis
SE0006504445

Värderingsdatum: 2019-09-30

Historisk utveckling

Utvecklingen av underliggande instrumentet sedan placeringens startdag:



Statusrapport för Danske Bank DDBO 405 Kreditindexbevis SE0006504445

Värderingsdatum: 2019-09-30

Historisk utveckling

Kredithändelser

Datum	Namn	Händelsebeskrivning	Händelsenummer	Utestående nominellt belopp
2015-12-11	Abengoa S.A.	Konkurs	1	98,67 %
2016-04-18	Norske Skogindustrier ASA	Omstrukturering	2	97,33 %
2016-06-21	Portugal Telecom International Finance B.V.	Konkurs	3	96,00 %
2016-07-28	Grupo Isolux Corsan Finance B.V.	Konkurs	4	94,67 %
2018-10-01	Astaldi S.p.A	Konkurs	5	93,33 %

Kupongutbetalning

Ränteberäkningsperiod	Antal Dagar	Utbetald kupong	Ränteförfallodagar
1 2015-01-02 till 2015-12-20	348	$98,67\% \times 6,01\% \times 348/360 = 5,73\%$	2015-12-20
2 2015-12-20 till 2016-12-20	360	$94,67\% \times 6,01\% \times 360/360 = 5,69\%$	2016-12-20
3 2016-12-20 till 2017-12-20	360	$94,67\% \times 6,01\% \times 360/360 = 5,69\%$	2017-12-20
4 2017-12-20 till 2018-12-20	360	$93,33\% \times 6,01\% \times 360/360 = 5,61\%$	2018-12-20
5 2018-12-20 till 2020-01-20			2020-01-20

Liite A – Kohde-etuuden viiteyhtiöt

Bolagsnamn	Nykyinen luottoluokitus		Vikt	Tapahtuma
	S&P	Moody's		
Abengoa S.A.			0,00 %	Konkurs 2015.12.11
Alcatel-Lucent			1,33 %	Nej
Altice Finco Inc	CCC+	Caa1	1,33 %	Nej
ArcelorMittal S.A.			1,33 %	Nej
Ardagh Packaging Finance Plc			1,33 %	Nej
Astaldi S.p.A			0,00 %	Konkurs 2018.10.01
Beni Stabili S.p.A. SIQ			1,33 %	Nej
Boparan Finance Plc	CCC+	Caa1	1,33 %	Nej
Brisa Concessao Rodoviaria S.A.			1,33 %	Nej
British Airways Plc			1,33 %	Nej
Cable & Wireless Ltd			1,33 %	Nej
Care UK Health & Social Care Plc			1,33 %	Nej
Cerved Group S.p.A.			1,33 %	Nej
CNH Industrial N.V.			1,33 %	Nej
Compagnie Industriali Riunite S.p.A			1,33 %	Nej
ConvaTec Healthcare E S.A.			1,33 %	Nej
DRY MIX SOLUTIONS INVESTISSEMENTS S.A.S			1,33 %	Nej
Eileme 2 AB (publ)			1,33 %	Nej
Energias de Portugal S.A. - EDP			1,33 %	Nej
Fiat Chrysler Automobiles N.V.			1,33 %	Nej
Financiere Quick SAS			1,33 %	Nej
Finmeccanica S.p.A.			1,33 %	Nej
Galapagos Holding S.A.	D	C	1,33 %	Nej
Galp Energia SGPS S.A.			1,33 %	Nej
Grupo Isolux Corsan Finance B.V.			0,00 %	Konkurs 2016.07.28
UnityMedia GmBH			1,33 %	Nej
HeidelbergCement AG			1,33 %	Nej
HEMA BondCo I B.V.			1,33 %	Nej
Hochtief AG	BBB		1,33 %	Nej
ICELAND BONDCO PLC			1,33 %	Nej
Ineos Group Holdings S.A.	B-		1,33 %	Nej
Jaguar Land Rover Automotive Plc	B+	B1	1,33 %	Nej
Ladbrokes Plc			1,33 %	Nej
LOCK LOWER HOLDING AS			1,33 %	Nej
Louis Dreyfus Commodities			1,33 %	Nej
Loxam SAS	B		1,33 %	Nej
Matalan Finance Plc			1,33 %	Nej
Melia Hotels International S.A.			1,33 %	Nej
Metsa Board Corporation			1,33 %	Nej
MONITCHEM HOLDCO 3 SA	B-	B2	1,33 %	Nej
New Look Bondco I Plc			1,33 %	Nej
Nokia Corporation			1,33 %	Nej
Norske Skogindustrier ASA			0,00 %	Omstrukturering 2016.04.18
NOVAFIVES SAS	B+		1,33 %	Nej

Statusrapport för Danske Bank DDBO 405 Kreditindexbevis
SE0006504445

Värderingsdatum: 2019-09-30

Liite A – Kohde-etuuden viiteyhtiöt (jatkuu)

Bolagsnamn	Nykyinen luottoluokitus		Vikt	Tapahtuma
	S&P	Moody's		
Numericable-SFR S.A.			1,33 %	Nej
NXP B.V.	BBB-		1,33 %	Nej
OTE S.A. (Hellenic Telecommunications Organization S.A.)			1,33 %	Nej
Peugeot S.A.			1,33 %	Nej
PIZZAEXPRESS FINANCING 1 PLC (EX Twinkle Pizza Holdings PLC)	CCC-	Caa2	1,33 %	Nej
Play Finance 1 S.A.			1,33 %	Nej
Portugal Telecom International Finance B.V.			0,00 %	Konkurs 2016.06.21
Premier Foods Finance plc	B		1,33 %	Nej
PUBLIC POWER CORPORATION FINANCE PLC			1,33 %	Nej
R&R Ice Cream Plc			1,33 %	Nej
Rallye			1,33 %	Nej
Rexel S.A.			1,33 %	Nej
Schaeffler Finance B.V.			1,33 %	Nej
Selecta Group B.V.			1,33 %	Nej
Smurfit Kappa Acquisitions	BB+	Ba1	1,33 %	Nej
Stena AB			1,33 %	Nej
Stonegate Pub Company Financing Plc			1,33 %	Nej
Stora Enso Oyj			1,33 %	Nej
Sunrise Communications Holdings S.A.			1,33 %	Nej
Techem GmbH			1,33 %	Nej
Telecom Italia S.p.A. (new)			1,33 %	Nej
ThyssenKrupp AG			1,33 %	Nej
Trionista HoldCo GmbH			1,33 %	Nej
TUI AG			1,33 %	Nej
TVN Finance Corporation III AB			1,33 %	Nej
Unilabs Subholding AB			1,33 %	Nej
UPC Holding B.V.			1,33 %	Nej
UPM-Kymmene Corporation			1,33 %	Nej
Virgin Media Finance Plc	B		1,33 %	Nej
Vougeot Bidco p.l.c.		B3	1,33 %	Nej
Wind Acquisition Finance S.A.			1,33 %	Nej

Viktig information

Eventuella rekommendationer häri är inte sk investeringsanalyser och har därför inte utformats enligt kraven i de lagar och författningar som fastställts för att främja investeringsanalyserns oberoende eller före spridningen av dessa. Danske Bank reserverar sig för felskrivningar på denna och alla tillhörande sidor. De värden som publiceras angående utvecklingen av Danske Banks aktieindexobligationer kan komma att ändras tills det att de är bekräftade vid aktieindexobligationens förfall. Inga beslut om köp och/eller försäljning bör därför fattas enbart på grundval av dessa värden.