

Statusrapport för Danske Bank DDBO 407 Kreditindexbevis

SE0006625711

Värderingsdatum: 2019-10-31

Korta fakta

| | |
|--|--|
| Beskrivning | Danske Bank DDBO 407 Kreditindexbevis är en icke kapitalskyddad placering med en löptid om ca 5 år. Investerarerna erhåller en årlig kupong om 4,20 %, 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 | 4,2 % av nominellt belopp |
| Ränteberekningsperiod | Från den 2015-02-27 t.o.m den 2019-12-20. |
| Datum Kupongutbetalning (Ränteförfallodagar) | 20:e december 2015-2020 (totalt 5 kuponger) |
| Kreditriskperiod | Från 2015-02-24 till och med 2019-12-20 |
| Likviddag | 27 februari 2015 |
| Återbetalningsdag | 20 januari 2020 |

Kreditindex

| Namn | Vikt |
|-----------------------------|-------|
| iTraxx Europe Crossover 22* | 100 % |

* För underliggande bolag se Bilaga A.

Historisk utveckling

Utvecklingen av underliggande instrumentet sedan placeringens startdag:



Statusrapport för Danske Bank DDBO 407 Kreditindexbevis
SE000662571 1

Värderingsdatum: 2019-10-31

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 2015-02-27 till 2015-12-21 | 294 | $98,67\% \times 4,20\% \times 294/360 = 3,38\%$ | 2015-12-21 |
| 2 2015-12-21 till 2016-12-20 | 359 | $94,67\% \times 4,20\% \times 359/360 = 3,96\%$ | 2016-12-20 |
| 3 2016-12-20 till 2017-12-20 | 360 | $94,67\% \times 4,20\% \times 360/360 = 3,98\%$ | 2017-12-20 |
| 4 2017-12-20 till 2018-12-20 | 360 | $93,33\% \times 4,20\% \times 360/360 = 3,92\%$ | 2018-12-20 |
| 5 2018-12-20 till 2020-01-20 | | | 2020-01-20 |

Läite 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 | | 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- | | 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 | | | 1,33 % | Nej |

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 | | | 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.