

Statusrapport för DDBOSC79

SE0011614502

Värderingsdatum: 2021-02-26

Korta fakta

Beskrivning	DDBO SC79 Kreditobl EUR IG är en icke kapitalskyddad ränteplacering med en löptid om ca 5 år. Investeraren erhåller en kupong på 5,83 % per år genom att ta på sig kreditrisken i Itraxx Europe S29. Obligationens nominella belopp betalas tillbaka på förfallodagen under förutsättning att maximalt två kredithändelser inträffat innan dess.
Valuta	SEK
Emissionskurs	100 % av nominellt belopp
Kapitalskydd	Nej
Kupong	5,83 % av nominellt belopp
Ränteberäkningsperiod	Från den 2018-11-12 t.o.m den 2023-06-20.
Datum Kupongutbetalning (Ränteförfallodagar)	9:e juli 2019-2023 (totalt 5 kuponger)
Kreditriskperiod	Från 2018-11-12 till och med 2023-06-20
Likviddag	12 november 2018
Återbetalningsdag	9 juli 2023

Kreditindex

Namn	Vikt
iTraxx Europe Series 29*	100 %

* För underliggande bolag se Bilaga A.

Statusrapport för DDBOSC79

SE0011614502

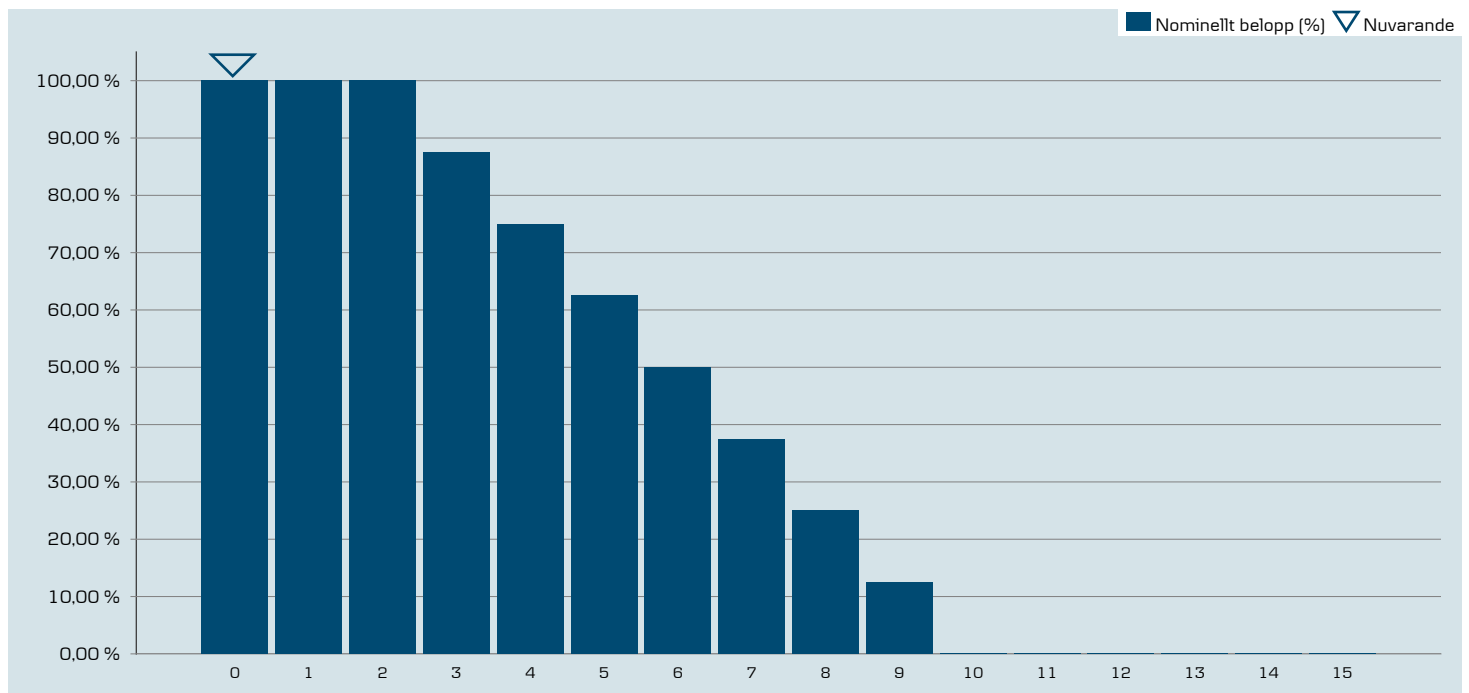
Värderingsdatum: 2021-02-26

Historisk utveckling

Utvecklingen av underliggande instrumentet sedan placeringens startdag:



Återbetalningsbelopp i förhållande till antalet kredithändelser



Statusrapport för DDBOSC79

SE0011614502

Värderingsdatum: 2021-02-26

Historisk utveckling

Kupongutbetalning

Ränteberäkningsperiod	Antal Dagar	Utbetald kupong	Ränteförfallodagar
1 2018-11-12 till 2019-06-20	218	$100,00 \% \times 5,83 \% \times 218/360 = 3,53 \%$	2019-07-09
2 2019-06-20 till 2020-06-22	362	$100,00 \% \times 5,83 \% \times 362/360 = 5,86 \%$	2020-07-09
3 2020-06-22 till 2021-06-21			2021-07-09
4 2021-06-21 till 2022-06-20			2022-07-09
5 2022-06-20 till 2023-06-20			2023-07-09

Liite A – Kohde-etuuden viiteyhtiöt

Bolagsnamn	Nykyinen luottoluokitus		Vikt	Tapahtuma
	S&P	Moody's		
Anglo American PLC	BBB		0,80 %	Nej
GKN HOLDINGS LTD (Senior Unsecured)	BBB-	Baa3	0,80 %	Nej
Deutsche Lufthansa AG	BB-		0,80 %	Nej
CECONOMY AG		Ba1	0,80 %	Nej
Repsol SA	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Heidelbergcement AG	BBB-	Baa3	0,80 %	Nej
STMicroelectronics NV	BBB		0,80 %	Nej
Renault SA	BB+		0,80 %	Nej
Wendel SE	BBB		0,80 %	Nej
Anheuser Busch Inbev NV	BBB+	A2	0,80 %	Nej
Accor SA	BB+		0,80 %	Nej
Aegon NV	A-	A3	0,80 %	Nej
Koninklijke Ahold Delhaize NV	BBB	Baa1	0,80 %	Nej
Airbus SE	A		0,80 %	Nej
Akzo Nobel NV	BBB+		0,80 %	Nej
Allianz SE	AA		0,80 %	Nej
Atlantia SpA	BB-	Baa2	0,80 %	Nej
Auchan Holding SA	BBB-		0,80 %	Nej
Aviva PLC	A	A2	0,80 %	Nej
AXA SA	A	A2	0,80 %	Nej
BAE Systems PLC	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Banco Santander SA	A	A2	0,80 %	Nej
BASF SE	A	A1	0,80 %	Nej
Bayer AG	BBB	A3	0,80 %	Nej
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	A-	A3	0,80 %	Nej
Bertelsmann SE & Co KGaA	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Bayerische Motoren Werke AG	A	A2	0,80 %	Nej
BNP Paribas SA	A+	Aa3	0,80 %	Nej
BP PLC	A-	A1	0,80 %	Nej
British American Tobacco PLC	BBB+	Baa2	0,80 %	Nej
British Telecommunications PLC	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Carlsberg Breweries A/S		Baa2	0,80 %	Nej
Carrefour SA	BBB		0,80 %	Nej
Centrica PLC	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Compagnie de Saint Gobain SA	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Commerzbank AG	BBB+	A1	0,80 %	Nej
Continental AG	BBB		0,80 %	Nej
Credit Agricole SA	A+	Aa3	0,80 %	Nej
Credit Suisse Group AG	BBB+	Baa2	0,80 %	Nej
Daimler AG	BBB+	A2	0,80 %	Nej
Danone SA	BBB+	Baa1	0,80 %	Nej
Danske Bank A/S	A	A3	0,80 %	Nej
Deutsche Bank AG	BBB+	A3	0,80 %	Nej
Deutsche Telekom AG	BBB	Baa1	0,80 %	Nej

Liite A – Kohde-etuuden viiteyhtiöt (jatkuu)

Bolagsnamn	Nykyinen luottoluokitus		Vikt	Tapahtuma
	S&P	Moody's		
Diageo PLC	A-	A3	0,80 %	Nej
E.ON SE	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Electricite de France SA	BBB+	A3	0,80 %	Nej
Electrolux AB	A-		0,80 %	Nej
Enel SpA	BBB+	Baa2	0,80 %	Nej
Engie SA	BBB+	Baa1	0,80 %	Nej
Eni SpA	A-	Baa1	0,80 %	Nej
Experian Finance PLC	A-	Baa1	0,80 %	Nej
Fortum Oyj	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
NATURGY ENERGY GROUP, S.A.	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Assicurazioni Generali SpA			0,80 %	Nej
Glencore International AG	BBB+		0,80 %	Nej
GlaxoSmithKline PLC	A	A2	0,80 %	Nej
Hannover Rueck SE	AA-		0,80 %	Nej
Heineken NV	BBB+	Baa1	0,80 %	Nej
Iberdrola SA	BBB+	Baa1	0,80 %	Nej
Imperial Brands PLC	BBB	Baa3	0,80 %	Nej
Intesa Sanpaolo SpA	BBB	Baa1	0,80 %	Nej
ITV PLC	BBB-	Baa3	0,80 %	Nej
Kering SA	A-		0,80 %	Nej
Koninklijke DSM NV	A-	A3	0,80 %	Nej
Koninklijke KPN NV	BBB	Baa3	0,80 %	Nej
Lafargeholcim Ltd	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	A+		0,80 %	Nej
Marks and Spencer PLC	BB+	Baa3	0,80 %	Nej
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	BBB	Baa1	0,80 %	Nej
Muenchener Rueckversicherungs Gesellschaft AG in Muenchen	AA-		0,80 %	Nej
National Grid PLC	A-	Baa1	0,80 %	Nej
Nestle SA	AA-	Aa3	0,80 %	Nej
Next PLC	BBB-		0,80 %	Nej
Orange SA	BBB+	Baa1	0,80 %	Nej
Pearson PLC	BBB-	Baa3	0,80 %	Nej
Pernod Ricard SA	BBB+	Baa1	0,80 %	Nej
Koninklijke Philips NV	BBB+	Baa1	0,80 %	Nej
Prudential PLC	A	A2	0,80 %	Nej
Publicis Groupe SA	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Cooperatieve Rabobank UA	A+	Aa3	0,80 %	Nej
Relx PLC	BBB+		0,80 %	Nej
Rolls-Royce PLC	BB-		0,80 %	Nej
Safeway Ltd			0,80 %	Nej
Sanofi SA	AA	A1	0,80 %	Nej
Royal Dutch Shell PLC	AA-		0,80 %	Nej
Siemens AG	A+	A1	0,80 %	Nej
SKY LTD (Senior Unsecured)	A-	Baa2	0,80 %	Nej

Statusrapport för DDBOSC79

SE0011614502

Värderingsdatum: 2021-02-26

Liite A – Kohde-etuuden viiteyhtiöt (jatkuu)

Bolagsnamn	Nykyinen luottoluokitus		Vikt	Tapahtuma
	S&P	Moody's		
Societe Generale	A	A1	0,80 %	Nej
Schweizerische Rueckversicherungs Gesellschaft AG	AA-	Aa3	0,80 %	Nej
SSE PLC	BBB+	A3	0,80 %	Nej
EQUINOR ASA	AA-	Aa3	0,80 %	Nej
Suedzucker AG	BBB-	Baa3	0,80 %	Nej
Tate & Lyle PLC	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Telefonica SA	BBB-	Baa3	0,80 %	Nej
Telekom Austria AG	BBB+	Baa1	0,80 %	Nej
Telenor ASA	A-	A3	0,80 %	Nej
Telia Company AB	BBB+	Baa1	0,80 %	Nej
TOTAL SE (Senior Unsecured)	A+	Aa3	0,80 %	Nej
UniCredit SpA	BBB	Baa1	0,80 %	Nej
Unilever NV			0,80 %	Nej
United Utilities PLC	BBB		0,80 %	Nej
Valeo SA	BB+	Baa3	0,80 %	Nej
Veolia Environnement SA	BBB	Baa1	0,80 %	Nej
Vinci SA	A-	A3	0,80 %	Nej
Vivendi SA	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Vodafone Group PLC	BBB	Baa1	0,80 %	Nej
Volkswagen AG	BBB+	A3	0,80 %	Nej
Volvo AB	A-	A3	0,80 %	Nej
Wolters Kluwer NV	BBB+		0,80 %	Nej
WPP 2005 Ltd	BBB		0,80 %	Nej
Zuerich Versicherungs Gesellschaft AG	AA-	A1	0,80 %	Nej
AstraZeneca PLC	BBB+	A3	0,80 %	Nej
LANXESS AG	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
Unibail Rodamco SE	BBB+		0,80 %	Nej
SES SA	BBB-	Baa2	0,80 %	Nej
Barclays PLC (Senior Unsecured)	BBB	Baa2	0,80 %	Nej
EDP Finance BV (Senior Unsecured)	BBB-		0,80 %	Nej
HSBC Holdings PLC (Senior Unsecured)	A-	A2	0,80 %	Nej
ING Groep NV (Senior Unsecured)	A-	Baa1	0,80 %	Nej
Lloyds Banking Group PLC (Senior Unsecured)	BBB+	A3	0,80 %	Nej
NatWest Group plc (Senior Unsecured)	BBB	Baa3	0,80 %	Nej
Standard Chartered PLC (Senior Unsecured)	BBB+	A2	0,80 %	Nej
UBS Group AG (Senior Unsecured)	A-		0,80 %	Nej
Innogy SE (Senior Unsecured)	BBB		0,80 %	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.