

Statusrapport för DDBO SR8 Europa Ränta Bas

ISIN: SE0011614569

Värderingsdatum: 2020-09-30

Korta fakta

Beskrivning	DDBO SR8 Europa Ränta Bas
Emissionskurs	100 % av nominellt belopp
Kapitalskydd	100 % av nominellt belopp
Deltagandegrad	50 %
Ränta	0,5 % på årsbasis
Ränteförfallodag	Årsvis den 18 december från 2019-12-18 till och med 2023-12-18
Likviddag	2018-12-18
Värderingsdag för Startkurs	2018-12-18
Värderingsdag för Slutkurs	En mätning sker per den 4:e varje månad, från 2022.06.04 till 2023.12.04. Totalt 19 månatliga mättillfällen.
Återbetalningsdag	2023-12-18
Valuta	SEK

Underliggande

Namn	Vikt	Startkurs
Centrica PLC	10 %	1,33
Engie	10 %	12,67
GlaxoSmithKline PLC	10 %	14,48
HSBC Holdings Plc	10 %	6,49
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	10 %	246,50

Namn	Vikt	Startkurs
Sampo Oyj	10 %	38,14
Siemens AG	10 %	90,34
Skandinaviska Enskilda BAN-A	10 %	87,70
SWISS RE AG	10 %	88,22
ZURICH INSURANCE GROUP AG	10 %	290,60

Ränteutbetalning

Ränteförfallodag	Ränta
1 2019-12-18	0,50 %
2 2020-12-18	0,50 %
3 2021-12-20	0,50 %
4 2022-12-19	0,50 %
5 2023-12-18	0,50 %
Totalt	2,50 %

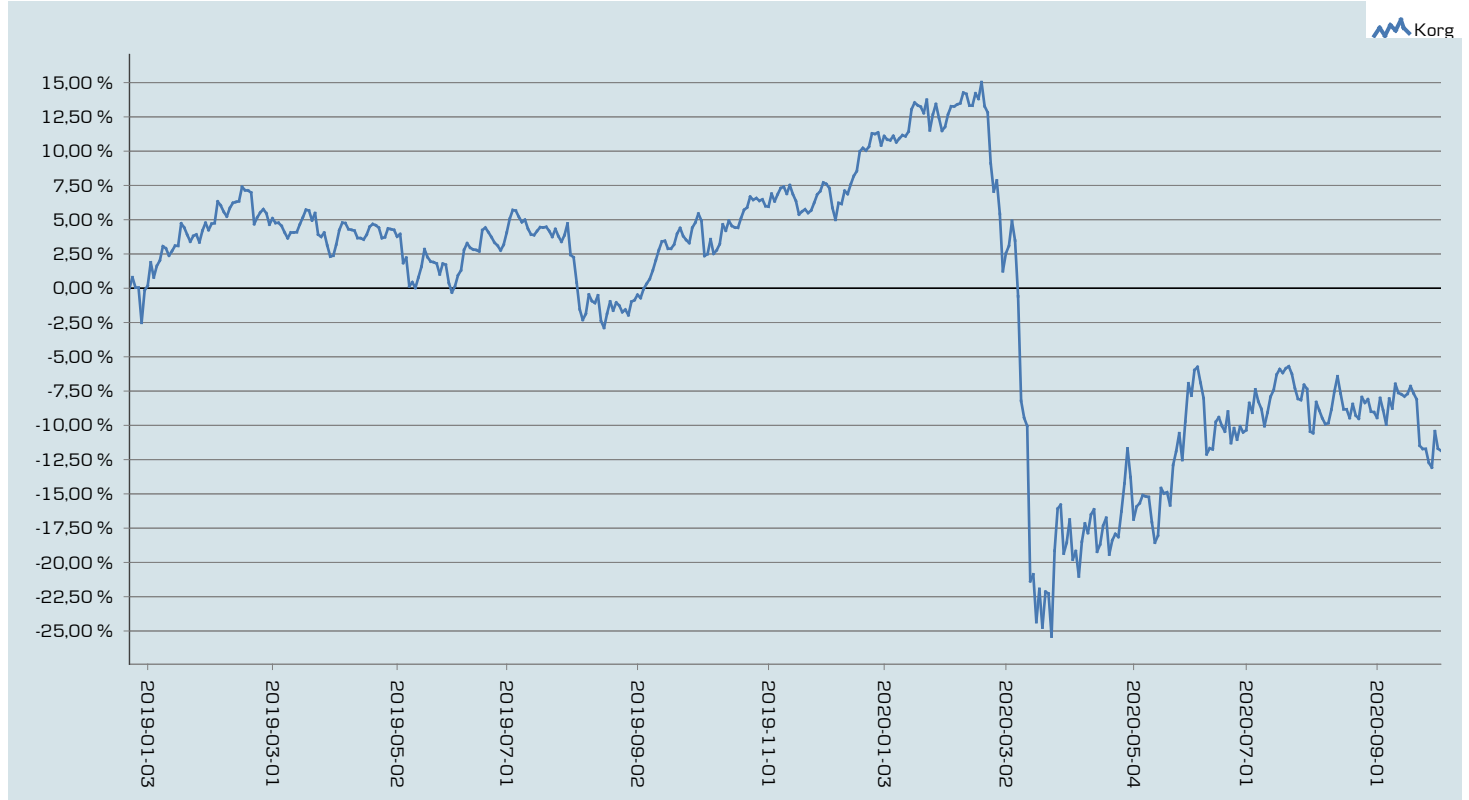
Statusrapport för DDBO SR8 Europa Ränta Bas

ISIN: SE0011614569

Värderingsdatum: 2020-09-30

Historisk utveckling

Utvecklingen av underliggande aktiekorg sedan placeringens startdag:



Värderingsdagar för Slutkurs

Observation	Utveckling	Detaljerad förklaring
1 2022-06-07*	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
2 2022-07-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
3 2022-08-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
4 2022-09-05*	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
5 2022-10-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
6 2022-11-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
7 2022-12-05*	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
8 2023-01-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
9 2023-02-06*	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
10 2023-03-06*	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
11 2023-04-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
12 2023-05-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
13 2023-06-05*	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
14 2023-07-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
15 2023-08-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
16 2023-09-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
17 2023-10-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
18 2023-11-06*	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
19 2023-12-04	-11,86%**	Se Bilaga A, sida 4
Genomsnitt	-11,86%	

Placeringens teoretiska återbetalning*** är beräknad som $\text{MAX}(\text{Utveckling Genomsnitt} \times \text{Deltagandegrad}; 0) + \text{Totalt Ränta} + 100\%$.
 Per dagens datum : $\text{MAX}(-11,86\% \times 50\%; 0) + 0,5\% + 100\% = 100,5\%$

* Observationsdatum flyttades enligt placeringens villkor.

** För framtida observationer, visas den senaste observationen som användes.

Statusrapport för DDBO SR8 Europa Ränta Bas

ISIN: SE0011614569

Värderingsdatum: 2020-09-30

Historisk utveckling

*** Placeringens teoretiska återbetalning: den återbetalningskurs av nominellt belopp som skulle ha uppnåtts om placeringen förföll idag, med idag som sista observationsdatum.

Statusrapport för DDBO SR8 Europa Ränta Bas

ISIN: SE0011614569

Värderingsdatum: 2020-09-30

Bilaga A - Detaljerad utveckling

Datum - 2020-09-30

Namn	Startkurs	Aktuell kurs	Utveckling
Centrica PLC	1,33	0,40	-69,86 %
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	246,50	315,15	27,85 %
Skandinaviska Enskilda BAN-A	87,70	79,64	-9,19 %
Engie	12,67	11,42	-9,87 %
HSBC Holdings Plc	6,49	3,02	-53,53 %
Siemens AG	90,34	107,88	19,42 %
GlaxoSmithKline PLC	14,48	14,52	0,26 %
SWISS RE AG	88,22	68,28	-22,60 %
Sampo Oyj	38,14	33,79	-11,40 %
ZURICH INSURANCE GROUP AG	290,60	320,70	10,36 %
Genomsnitt			-11,86 %

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.