

Kreditindexbevis Europa 4

ISIN: SE0004871010

Värderingsdatum: 2017-12-29

Värdering per 2017-12-29

| | |
|----------------------|----------|
| Marknadsvärde | 94,46 % |
| Teoretiskt slutvärde | 120,42 % |
| Utbetalda kuponger | 27,89 % |

Produktinformation

Kreditindexbevis Europa 4 är en placering där avkastningen är kopplad till kreditindexet iTraxx Crossover Europe Series 18 Index. Indexet består av de 50 mest likvida CDS-kontrakten på den europeiska CDS-marknaden med kreditbetyget BB+ eller lägre (high yield). Kreditindexbeviset är inte kapitalskyddat och har en löptid på cirka 5 år. Placeringen utbetalar en kupong varje kvartal. På årsbasis uppgår kupongsatsen till 5,8 procent + 3 månaders Stibor av utestående nominellt belopp. Denna placering är avsedd för dig som vill ha ett alternativ till aktieplaceringar.

| | |
|---------------------------------|---|
| Emittent | Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ) |
| Nominellt belopp | SEK 100 000 |
| Emissionskurs | 100% av Nominellt belopp |
| Kapitalskydd | Nej |
| Löptid | 5 år |
| Räntebas | 3 månaders Stibor |
| Kupong | Räntebas + 5,8% |
| Emissionsdag | 2013-01-08 |
| Startdag för observationsperiod | 2013-01-08 |
| Slutdag för observationsperiod | 2017-12-20 |
| Observationsdatum | Kvartalsvis från och med 2013-01-08 till och med Slutdag för observationsperiod. |
| Ränteperioder | Tiden från Emissionsdag till och med första Observationsdatum och därefter varje tidsperiod om ca 3 månader till och med Återbetalningsdagen. |
| Räntebestämningsdagar | Två bankdagar innan den första dagen i varje Ränteperiod. |
| Datum Kupongutbetalning | Kvartalsvis från 2013-04-15 till och 2018-01-15 |
| Återbetalningsdag | 2018-01-15 |

Underliggande tillgångar

| Inriktning | Namn | Vikt |
|------------|-----------------------------------|-------|
| Europa | iTraxx Crossover Europe Series 18 | 100 % |
| Europa | 3 månaders Stibor | - |

För specifiering av underliggande bolag se Bilaga 1.

Kupongutbetalningsdagar

| Räntebestämningdaga | Observationsdatum | Räntebas | Kupong | Antal Dagar | Utbetald kupong | Datum Kupongutbetalning | |
|---------------------|-------------------|------------|---------|-------------|-----------------|---|------------|
| 1 | 2013-01-04 | 2013-03-20 | 1,242% | 7,042% | 71 | $(100\% - 2\% \times 0) \times 7,042\% \times \frac{71}{360} = 1,389\%$ | 2013-04-15 |
| 2 | 2013-03-18 | 2013-06-20 | 1,236% | 7,036% | 92 | $(100\% - 2\% \times 0) \times 7,036\% \times \frac{92}{360} = 1,798\%$ | 2013-07-15 |
| 3 | 2013-06-18 | 2013-09-20 | 1,228% | 7,028% | 92 | $(100\% - 2\% \times 1) \times 7,028\% \times \frac{92}{360} = 1,76\%$ | 2013-10-15 |
| 4 | 2013-09-18 | 2013-12-20 | 1,218% | 7,018% | 91 | $(100\% - 2\% \times 1) \times 7,018\% \times \frac{91}{360} = 1,739\%$ | 2014-01-15 |
| 5 | 2013-12-18 | 2014-03-20 | 0,932% | 6,732% | 90 | $(100\% - 2\% \times 1) \times 6,732\% \times \frac{90}{360} = 1,649\%$ | 2014-04-15 |
| 6 | 2014-03-18 | 2014-06-20 | 0,929% | 6,729% | 92 | $(100\% - 2\% \times 1) \times 6,729\% \times \frac{92}{360} = 1,685\%$ | 2014-07-15 |
| 7 | 2014-06-18 | 2014-09-22 | 0,865% | 6,665% | 92 | $(100\% - 2\% \times 1) \times 6,665\% \times \frac{92}{360} = 1,669\%$ | 2014-10-15 |
| 8 | 2014-09-19 | 2014-12-22 | 0,474% | 6,274% | 91 | $(100\% - 2\% \times 1) \times 6,274\% \times \frac{91}{360} = 1,554\%$ | 2015-01-15 |
| 9 | 2014-12-19 | 2015-03-20 | 0,259% | 6,059% | 90 | $(100\% - 2\% \times 1) \times 6,059\% \times \frac{90}{360} = 1,484\%$ | 2015-04-15 |
| 10 | 2015-03-18 | 2015-06-22 | 0,034% | 5,834% | 92 | $(100\% - 2\% \times 1) \times 5,834\% \times \frac{92}{360} = 1,461\%$ | 2015-07-15 |
| 11 | 2015-06-19 | 2015-09-21 | -0,211% | 5,589% | 92 | $(100\% - 2\% \times 1) \times 5,589\% \times \frac{92}{360} = 1,4\%$ | 2015-10-15 |
| 12 | 2015-09-18 | 2015-12-21 | -0,295% | 5,505% | 91 | $(100\% - 2\% \times 1) \times 5,505\% \times \frac{91}{360} = 1,364\%$ | 2016-01-15 |
| 13 | 2015-12-18 | 2016-03-21 | -0,401% | 5,399% | 91 | $(100\% - 2\% \times 1) \times 5,399\% \times \frac{91}{360} = 1,337\%$ | 2016-04-15 |
| 14 | 2016-03-18 | 2016-06-20 | -0,469% | 5,331% | 92 | $(100\% - 2\% \times 2) \times 5,331\% \times \frac{92}{360} = 1,281\%$ | 2016-07-15 |
| 15 | 2016-06-17 | 2016-09-20 | -0,461% | 5,339% | 92 | $(100\% - 2\% \times 4) \times 5,339\% \times \frac{92}{360} = 1,283\%$ | 2016-10-17 |
| 16 | 2016-09-16 | 2016-12-20 | -0,469% | 5,331% | 91 | $(100\% - 2\% \times 4) \times 5,331\% \times \frac{91}{360} = 1,267\%$ | 2017-01-16 |
| 17 | 2016-12-16 | 2017-03-20 | -0,616% | 5,184% | 90 | $(100\% - 2\% \times 4) \times 5,184\% \times \frac{90}{360} = 1,218\%$ | 2017-04-18 |
| 18 | 2017-03-17 | 2017-06-20 | -0,489% | 5,311% | 92 | $(100\% - 2\% \times 4) \times 5,311\% \times \frac{92}{360} = 1,276\%$ | 2017-07-17 |
| 19 | 2017-06-16 | 2017-09-20 | -0,503% | 5,297% | 92 | $(100\% - 2\% \times 4) \times 5,297\% \times \frac{92}{360} = 1,272\%$ | 2017-10-16 |
| 20 | 2017-09-18 | 2017-12-20 | -0,411% | 5,389% | 91 | $(100\% - 2\% \times 4) \times 5,389\% \times \frac{91}{360} = 1,28\%$ | 2018-01-15 |

Kredithändelser

| Namn | Händelsebeskrivning | Händelsenummer |
|---|-----------------------|----------------|
| Norske Skogindustrier ASA | Restructuring | 1 |
| Portugal Telecom International Finance B.V. | Bankruptcy | 2 |
| Codere Finance (Luxembourg) S.A. | Betalningsinställelse | 3 |

Definitionen av kredithändelse följer av vad som är standard på kapitalmarknaden. Händelserna som omfattas är: (a) Bolagskonkurs och liknande händelser (b) Betalningsinställelse; (c) Betalningsrekonstruktion av utestående skuld. Med konkurs menas att bolaget är på obestånd. Betalningsinställelse innebär att bolag inte i rätt tid fullgör sina betalningspliktigheter avseende finansiell skuld motsvarande minimum USD 1 miljon. Betalningsrekonstruktion innebär bland annat att bolaget ändrar ränte- eller återbetalningsbelopp på utestående finansiell skuld om minimum USD 10 miljoner till följd av försämrade kreditvärdighet eller minskad finansiell styrka.

Teoretiskt slutvärde

| | |
|--|---|
| Teoretiskt slutvärde* beräknas per månadsrapportens värderingsdatum enligt formeln: | $(100\% - 2\% \times \text{antal kredithändelser}) \times (100\% + \text{Ränta innevarande period} \times \text{Antal år innevarande period} + \text{Senaste ränta} \times \text{Antal år kvar till förfall från nästa observationsdatum}) + \text{Fastställda kuponger}^{***}$ |
| Vilket motsvarar: | $(100\% - 2\% \times 3) \times (100\% + 5,389\% \times 0,197 + 5,248\% \times 4,894) + 1,28\% = 120,424\%$ |
| Teoretisk produktavkastning** beräknas enligt formeln: | $(\text{Teoretiskt slutvärde} + \text{Redan utbetalda kuponger} - \text{Emissionskurs}) / \text{Emissionskurs}$ |
| Vilket motsvarar: | $(120,424\% + 27,886\% - 100\%) / 100\% = 48,311\%$ |

* Det teoretiska slutvärdet visar det värde som placeringen kommer att ha på återbetalningsdagen under förutsättning att den underliggande marknaden som gäller för placeringen är oförändrad jämfört med dagens nivå.

** Den teoretiska produktavkastningen visar den avkastning som placeringen kommer att ha gett på återbetalningsdagen, inklusive eventuella utbetalda och framtida kuponger, under förutsättning att den/de underliggande marknad(er) som gäller för placeringen är oförändrad(e) jämfört med dagens nivå. Detta förutsätter att placeringen ägts sedan start. Beräkningar är gjorda exklusive courtage.

*** Det teoretiska slutvärdet visar det värde som placeringen kommer att ha på återbetalningsdagen, inklusive framtida kupongutbetalningar, under förutsättning att antalet kredithändelser som gäller för placeringen är oförändrade jämfört med dagens antal. Eventuella fastställda kuponger innebär kuponger som redan fastställts men ännu ej utbetalats.

Denna placering är inte kapitalskyddad. Det betyder att det insatta beloppet både kan öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade beloppet. Återbetalningsbeloppet betalas ut under förutsättning att emittenten kan fullfölja sina förpliktelser på återbetalningsdagen. För mer information om emittentrisk och övriga risker, se prospekt och slutgiltiga villkor.

Bilaga 1 - Underliggande tillgångar

| Inriktning | Namn | Vikt |
|------------|---|------|
| Europa | Air France S.A. | 2% |
| Europa | Alcatel-Lucent | 2% |
| Europa | ArcelorMittal S.A. | 2% |
| Europa | Ardagh Packaging Finance Plc | 2% |
| Europa | Brisa Concessao Rodoviaria S.A. | 2% |
| Europa | British Airways Plc | 2% |
| Europa | Cable & Wireless Ltd | 2% |
| Europa | Clariant AG | 2% |
| Europa | CNH Industrial N.V. | 2% |
| Europa | Codere Finance (Luxembourg) S.A. | 2% |
| Europa | Compagnie Industriale Riunite S.p.A | 2% |
| Europa | ConvaTec Healthcare E S.A. | 2% |
| Europa | Dixons Retail Plc | 2% |
| Europa | Eileme 2 AB (publ) | 2% |
| Europa | Energias de Portugal S.A. - EDP | 2% |
| Europa | Fiat Chrysler Automobiles N.V. | 2% |
| Europa | Finmeccanica S.p.A. | 2% |
| Europa | Grohe Aktiengesellschaft | 2% |
| Europa | Havas S.A. | 2% |
| Europa | HeidelbergCement AG | 2% |
| Europa | Ineos Group Holdings Limited | 2% |
| Europa | ISS A/S | 2% |
| Europa | Jaguar Land Rover Automotive Plc | 2% |
| Europa | Kabel Deutschland Vertrieb und Service GmbH | 2% |
| Europa | Ladbroke Plc | 2% |

| Inriktning | Namn | Vikt |
|------------|---|------|
| Europa | Lafarge S.A. | 2% |
| Europa | Melia Hotels International S.A. | 2% |
| Europa | Metsa Board Corporation | 2% |
| Europa | Nokia Corporation | 2% |
| Europa | Norske Skogindustrier ASA | 2% |
| Europa | NXP B.V. | 2% |
| Europa | ONO Finance II Plc | 2% |
| Europa | OTE S.A. (Hellenic Telecommunications Organization S. A.) | 2% |
| Europa | Peugeot S.A. | 2% |
| Europa | Portugal Telecom International Finance B.V. | 2% |
| Europa | Rallye | 2% |
| Europa | Renault S.A. | 2% |
| Europa | Repsol S.A. | 2% |
| Europa | Schaeffler Finance B.V. | 2% |
| Europa | Stena AB | 2% |
| Europa | Stora Enso Oyj | 2% |
| Europa | Sunrise Communications Holdings S. A. | 2% |
| Europa | ThyssenKrupp AG | 2% |
| Europa | TUI AG | 2% |
| Europa | UnityMedia GmbH | 2% |
| Europa | UPC Holding B.V. | 2% |
| Europa | UPM-Kymmene Corporation | 2% |
| Europa | Wendel | 2% |
| Europa | Wind Acquisition Finance S.A. | 2% |
| Europa | Virgin Media Finance Plc | 2% |

Viktig information

Detta dokument utgör inte någon investeringsanalys eller annan rekommendation gällande investeringar. Dokumentet har därför inte utformats enligt kraven i de lagar och författningar och branchföreskrifter som gäller för investeringsanalyser och investeringsrekommendationer. Skandiabanken reserverar sig för felskrivningar på denna och alla tillhörande sidor. De värden som publiceras angående utvecklingen av Skandiabankens strukturerade produkter kan komma att ändras tills dess att de är bekräftade vid den strukturerade produktens förfall. Inga beslut om köp och/eller försäljning bör därför fattas enbart på grundval av dessa värden. För fullständig information hänvisar vi till beskrivningen av placeringen i broschyr, prospekt samt slutgiltiga villkor.