

Kreditindexbevis Europa 5

ISIN: SE0004950178

Värderingsdatum: 2017-12-29

Värdering per 2017-12-29

Marknadsvärde	96,39 %
Teoretiskt slutvärde	98,01 %
Utbetalda kuponger	31,20 %

Produktinformation

Kreditindexbevis Europa 5 är en placering där avkastningen är kopplad till kreditindexet iTraxx Crossover Europe Series 18 Index. Kreditindexbeviset är inte kapitalskyddat och har en löptid på 5 år. Placeringen betalar en kupong varje halvår. På årsbasis uppgår kupongen till 7,5 procent av utestående nominellt belopp. För varje kredithändelse som inträffar i kreditindexet reduceras utestående nominellt belopp med två procentenheter.

Emittent	Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ)
Nominellt belopp	SEK 50 000
Emissionskurs	100% av Nominellt belopp
Kapitalskydd	Nej
Löptid	4,9 år
Kupong	7,5%
Emissionsdag	2013-02-28
Värderingsdag för Startindex	2013-02-28
Observationsdatum	2013-02-28 och halvårsvis till och med 2017-12-20
Datum Kupongutbetalning	2014-01-15 och halvårsvis till och med 2018-01-15
Återbetalningsdag	2018-01-15

Underliggande tillgångar

Inriktning	Namn	Vikt
Europa	iTraxx Crossover Europe Series 18	100 %

För specificering av underliggande bolag se Bilaga 1.

Kupongutbetalningsdagar

Datum	Antal Dagar	Utbetald kupong
1 2014-01-15	290	$(100\% - 2\% \times 1) \times 7,5\% \times 290/360 = 5,921\%$
2 2014-07-15	180	$(100\% - 2\% \times 1) \times 7,5\% \times 180/360 = 3,675\%$
3 2015-01-15	180	$(100\% - 2\% \times 1) \times 7,5\% \times 180/360 = 3,675\%$
4 2015-07-15	180	$(100\% - 2\% \times 1) \times 7,5\% \times 180/360 = 3,675\%$
5 2016-01-15	180	$(100\% - 2\% \times 1) \times 7,5\% \times 180/360 = 3,675\%$
6 2016-07-15	180	$(100\% - 2\% \times 2) \times 7,5\% \times 180/360 = 3,525\%$
7 2017-01-16	180	$(100\% - 2\% \times 4) \times 7,5\% \times 180/360 = 3,525\%$
8 2017-07-17	180	$(100\% - 2\% \times 4) \times 7,5\% \times 180/360 = 3,525\%$
9 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 försämrad kreditvärdighet eller minskad finansiell styrka.

Teoretiskt slutvärde

Teoretiskt slutvärde* beräknas per månadsrapportens värderingsdatum enligt formeln:	$(100\% - 2\% \times \text{antal kredithändelser}) \times (100\% + 7,5\% \times \text{Antal år kvar till förfall vid senaste observationsdatum}) + \text{Fastställda kuponger}^{***}$
Vilket motsvarar:	$(100\% - 2\% \times 3) \times (100\% + 7,5\% \times 0,569) + 0\% = 98,015\%$
Teoretisk produktavkastning** beräknas enligt formeln:	$(\text{Teoretiskt slutvärde} + \text{Redan utbetalda kuponger} - \text{Emissionskurs}) / \text{Emissionskurs}$
Vilket motsvarar:	$(98,015\% + 31,196\% - 100\%) / 100\% = 29,21\%$

- * 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.