

# Kreditindexbevis Europa 11

ISIN: SE0007954201

Värderingsdatum: 2017-12-29

## Värdering per 2017-12-29

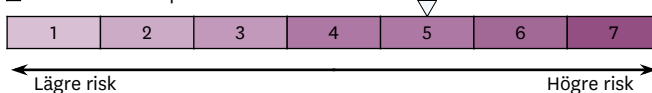
Marknadsvärde	111,67 %
Teoretiskt slutvärde	110,45 %
Utbetalda kuponger	3,92 %

## Riskindikator

(Placeringens risknivå är fastställd vid emissionens genomförande och kan förändras under placeringens löptid)

Risknivå normalutfall – Hur stor är risken i placeringen?

Vid emissionstidpunkten



Risknivå extremutfall –

Hur stor blir förlusten i händelse av ett extremutfall?

Vid emissionstidpunkten

Emittent: Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ)

Emittentrisk: S&P: A+ / Moody's: Aa3 / Fitch: AA-

Ovanstående riskmätt är framtagna och beräknade enligt den svenska branchkoden för Strukturerade Placeringar i Sverige (SPIS). Hemsida [www.strukturerade.se](http://www.strukturerade.se)

## Produktinformation

Kreditindexbevis Europa 11 är en placering som är knuten till kreditrisken i 75 europeiska bolag genom indexet iTraxx Crossover Europe S24. Placeringen är avsedd för dig som vill ha ett alternativ till aktieplaceringar och är villig att ta kreditrisk mot 75 europeiska bolag med skydd mot de 9 första Kredithändelserna.

Nominellt belopp	SEK 50 000
Emissionskurs	100% av Nominellt belopp
Kapitalskydd	Nej
Löptid	4,7 år
Kupong	6,5%
Emissionsdag	2016-05-13
Värderingsdag för Startindex	2016-04-28
Observationsdatum	2016-04-28 och halvårsvis till och med 2020-12-21
Datum Kupongutbetalning	2017-01-16 och halvårsvis till och med 2021-01-15
Återbetalningsdag	2021-01-15

## Underliggande tillgångar

Inriktning	Namn	Vikt
Europa	iTraxx Crossover Europe Series 24	100 %

För specificering av underliggande bolag se Bilaga 1.

## Kupongutbetalningsdagar

Datum	Antal Dagar	Utbetald kupong
1 2017-01-16	217	$(100\% - 6,67\% \times 3) \times 6,5\% \times 217/360 = 3,918\%$
2 2018-01-15	360	$(100\% - 6,67\% \times 3) \times 6,5\% \times 360/360 = 6,5\%$
3 2019-01-15		
4 2020-01-15		
5 2021-01-15		

## Kredithändelser

Namn	Händelsebeskrivning	Händelsenummer
Grupo Isolux Corsan Finance B.V.	Bankruptcy	1
Portugal Telecom International Finance B.V.	Bankruptcy	2

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

<b>Teoretiskt slutvärde* beräknas per månadsrapportens värderingsdatum enligt formeln:</b>	$(100\% - 6,67\% \times \text{MIN}(15; \text{MAX}(0; \text{antal kredithändelser} - 9))) \times (100\% + 6,5\% \times \text{Antal år kvar till förfall vid senaste observationsdatum}) + \text{Fastställda kuponger}^{***}$
<b>Vilket motsvarar:</b>	$(100\% - 6,67\% \times 2) \times (100\% + 6,5\% \times 3,069) + 6,5\% = 110,45\%$
<b>Teoretisk produktavkastning** beräknas enligt formeln:</b>	$(\text{Teoretiskt slutvärde} + \text{Redan utbetalda kuponger} - \text{Emissionskurs}) / \text{Emissionskurs}$
<b>Vilket motsvarar:</b>	$(110,45\% + 3,918\% - 100\%) / 100\% = 14,368\%$

- \* 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-KLM	1,333%
Europa	Alcatel-Lucent	1,333%
Europa	Altice Finco Inc	1,333%
Europa	ArcelorMittal S.A.	1,333%
Europa	Ardagh Packaging Finance Plc	1,333%
Europa	Astaldi S.p.A	1,333%
Europa	Beni Stabili S.p.A. SIIQ	1,333%
Europa	Boparan Finance Plc	1,333%
Europa	British Airways Plc	1,333%
Europa	Cable & Wireless Ltd	1,333%
Europa	Care UK Health & Social Care Plc	1,333%
Europa	Cerved Group S.p.A.	1,333%
Europa	CNH Industrial N.V.	1,333%
Europa	ConvaTec Healthcare E S.A.	1,333%
Europa	Deutsche Lufthansa AG	1,333%
Europa	DRY MIX SOLUTIONS INVESTISSEMENTS S.A.S	1,333%
Europa	Energias de Portugal S.A. - EDP	1,333%
Europa	EPHIOS HOLDCO II PLC	1,333%
Europa	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	1,333%
Europa	Financiere Quick SAS	1,333%
Europa	Finmeccanica S.p.A.	1,333%
Europa	Galapagos Holding S.A.	1,333%
Europa	Galp Energia SGPS S.A.	1,333%
Europa	Grupo Isolux Corsan Finance B.V.	1,333%
Europa	HeidelbergCement AG	1,333%
Europa	HEMA BondCo I B.V.	1,333%
Europa	Hochtief AG	1,333%
Europa	ICELAND BONDCO PLC	1,333%
Europa	Ineos Group Holdings S.A.	1,333%
Europa	International Game Technology PLC	1,333%
Europa	Jaguar Land Rover Automotive Plc	1,333%
Europa	J Sainsbury Plc	1,333%
Europa	Ladbrokes Plc	1,333%
Europa	LOCK LOWER HOLDING AS	1,333%
Europa	Louis Dreyfus Commodities	1,333%
Europa	Loxam SAS	1,333%
Europa	Matalan Finance Plc	1,333%
Europa	Matterhorn Telecom Holding S.A.	1,333%

Inriktning	Namn	Vikt
Europa	Melia Hotels International S.A.	1,333%
Europa	Metsa Board Corporation	1,333%
Europa	MONITCHEM HOLDCO 3 SA	1,333%
Europa	NEW LOOK SENIOR ISSUER PLC	1,333%
Europa	Nokia Corporation	1,333%
Europa	NOVAFIVES SAS	1,333%
Europa	Numericable-SFR S.A.	1,333%
Europa	NXP B.V.	1,333%
Europa	OTE S.A. (Hellenic Telecommunications Organization S. A.)	1,333%
Europa	Peugeot S.A.	1,333%
Europa	PIZZAEXPRESS FINANCING 1 PLC (EX Twinkle Pizza Holdings PLC)	1,333%
Europa	Play Finance 1 S.A.	1,333%
Europa	Portugal Telecom International Finance B.V.	1,333%
Europa	Premier Foods Finance plc	1,333%
Europa	R&R Ice Cream Plc	1,333%
Europa	Rallye	1,333%
Europa	Renault S.A.	1,333%
Europa	Rexel S.A.	1,333%
Europa	Schaeffler Finance B.V.	1,333%
Europa	Selecta Group B.V.	1,333%
Europa	Stena AB	1,333%
Europa	Stonegate Pub Company Financing Plc	1,333%
Europa	Stora Enso Oyj	1,333%
Europa	Sunrise Communications Holdings S. A.	1,333%
Europa	Techem GmbH	1,333%
Europa	Telecom Italia S.p.A. (new)	1,333%
Europa	Tesco Plc	1,333%
Europa	ThyssenKrupp AG	1,333%
Europa	Trionista HoldCo GmbH	1,333%
Europa	TUI AG	1,333%
Europa	Unilabs Subholding AB	1,333%
Europa	Unitymedia GmbH	1,333%
Europa	UPC Holding B.V.	1,333%
Europa	Wind Acquisition Finance S.A.	1,333%
Europa	Virgin Media Finance Plc	1,333%
Europa	Vougeot Bidco p.l.c.	1,333%
Europa	Ziggo Bond Finance B.V.	1,333%

### 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.