

DANSKE BANK DDBO FC29: Luottokorilaina Eurooppa XIV - Tilannekatsaus

ISIN: FI4000224167

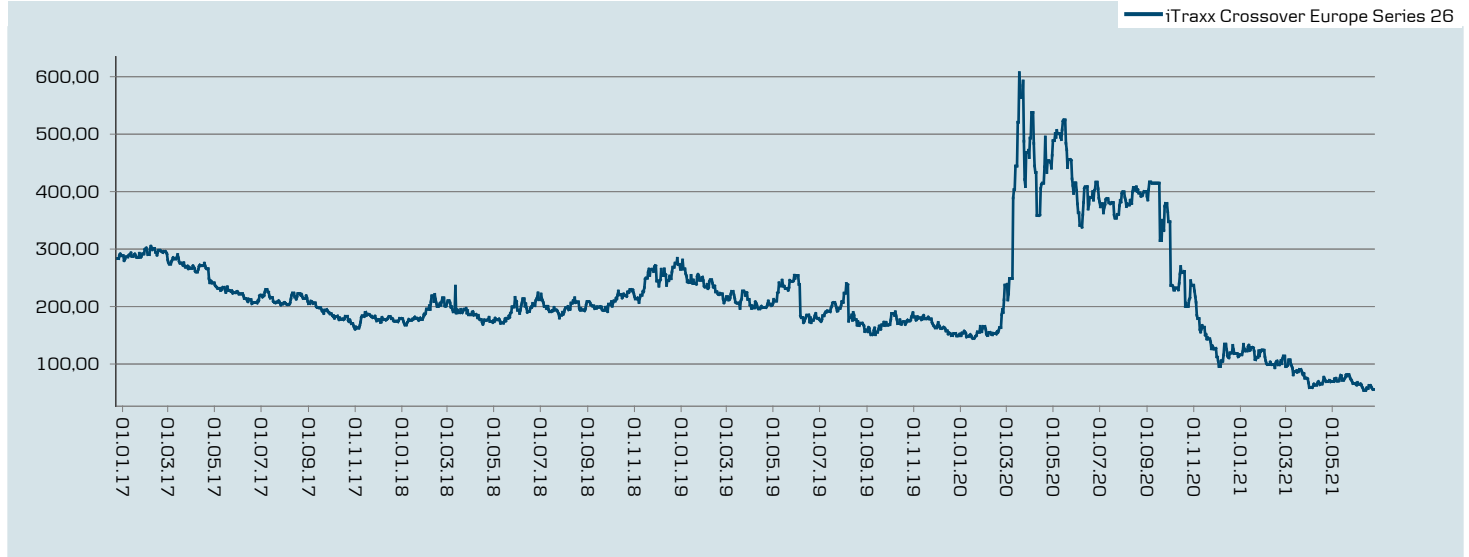
Takaisinostohinta (25.06.2021): 90,56

Tuotteen yleiset ehdot

Sijoitusstrategia	Danske Bank Luottokorilaina Eurooppa XIII on hajautetusti 75 eurooppalaisen high yield - yrityksen luottoriskiin sidottu, tuottohakuisille sijoittajille suunnattu ja korkeaa vuotuista tuottoa tavoitteleva ratkaisu.
Pääoman takaisinmaksu	Mikäli indeksiin kuuluva yhtiö kohtaa luottovastuutapahtuman, laina-ajan lopussa palautettava pääoma sekä sijoittajalle maksettava vuosittainen korko pienenevät. Kukin luottovastuutapahtuma pienentää laina-ajan lopussa palautettavaa pääomaa, sekä pääomaa jolle tuotto lasketaan, noin 1,33%-yksikköä
Kohde-etuus	iTraxx Crossover Europe Series 26
Liikkeeseenlaskupäivä	23.12.2016
Eräpäivä	15.01.2022
Vuotuinen korko	4,00% p.a.
Emissiokurssi	100%
Liikkeeseenlaskija	Danske Bank A/S
Valuutta	EUR
Kuponinmaksupäivät	Vuosittain. Maksut alkaen 09.01.2018 ja päättyen 09.01.2022. Yhteensä 5 maksua.

Historiallinen kehitys

Indeksin kehitys vaikuttaa jälkimarkkinahintaan, mutta ei palautettavaan pääomaan tai maksettavaan tuottoon. Muiden tekijöiden pysyessä muuttumattomana indeksin nousu (lasku) laskee (nostaa) jälkimarkkinahintaa.



Korko

Aika	Koronmaksupäivä	Korko	Jäljellä oleva pääoma	Maksettava/maksettu korko nimellispääomalle
1	09.01.2018	4,00%	100,00%	4,00%
2	09.01.2019	4,00%	98,67%	3,95%
3	09.01.2020	4,00%	96,00%	3,84%
4	11.01.2021	4,00%	90,66%	3,63%
5	10.01.2022	4,00%	90,66%*	3,63%*

* Tilanne raportointihetkellä, voi vielä muuttua.

Credit Events (summary)

Date	Nimi	Type of Default
01.10.2018	Astaldi SpA	konkurssi
16.05.2019	TOP GUN REALISATIONS 73 PLC (Senior Unsecured)	maksuhäiriö
23.07.2019	Galapagos Holding SA	rakenneuudistus
12.08.2020	Matalan Finance PLC	konkurssi
24.08.2020	HEMA BondCo I BV	maksuhäiriö
28.09.2020	Pizzaexpress Financing 1 PLC	maksuhäiriö
12.10.2020	Selecta Group BV	konkurssi

Liite A – iTraxx Crossover Europe Series 26

Yhtiön nimi	Luottoluokitukset		Paino	Luottovastuutapahtuma
	S&P	Moody's		
Matterhorn Telecom Holding SA	B+		1,33%	No
CECONOMY AG			1,33%	No
Astaldi SpA			0,00%	konkurssi 01.10.2018
Beni Stabili SpA Societa di Investimento Immobiliare Quotata			1,33%	No
Boparan Finance PLC	B-		1,33%	No
Cable & Wireless Ltd	BB-		1,33%	No
Schaeffler Finance BV	BB+		1,33%	No
Selecta Group BV			0,00%	konkurssi 12.10.2020
ALTICE FRANCE (Senior Unsecured)	B		1,33%	No
Smurfit Kappa Acquisitions Unlimited Co	BB+	Ba1	1,33%	No
Stena AB	B+		1,33%	No
Casino Guichard Perrachon SA	B		1,33%	No
Novafives SAS	B-		1,33%	No
NXP BV	BBB	Ba1	1,33%	No
Monitchem Holdco 3 SA	B-		1,33%	No
CMA CGM SA	B+		1,33%	No
CNH Industrial NV	BBB	Ba2	1,33%	No
ConvaTec Healthcare E SA			1,33%	No
Dry Mix Solutions Investissements SASU			1,33%	No
EDP Energias de Portugal SA	BBB-	Baa3	1,33%	No
Stellantis N.V. (Senior Unsecured)	BBB-	Ba3	1,33%	No
Financiere Quick SAS			1,33%	No
Galapagos Holding SA			0,00%	rakennemuutostus 23.07.2019
Galp Energia SGPS SA			1,33%	No
Hellenic Telecommunications Organization SA	BBB-		1,33%	No
Garfunkelux Holdco 2 SA	B+	Caa1	1,33%	No
GKN HOLDINGS LTD (Senior Unsecured)	BBB-	Baa3	1,33%	No
Heidelbergcement AG	BBB-	Baa3	1,33%	No
HEMA BondCo I BV			0,00%	maksuhäiriö 24.08.2020
Metsa Board Oyj	BBB-		1,33%	No
Nokia Oyj	BB+		1,33%	No
PEUGEOT SA		Ba1	1,33%	No
Pizzaexpress Financing 1 PLC			0,00%	maksuhäiriö 28.09.2020
Play Finance 1 SA			1,33%	No
TOP GUN REALISATIONS 73 PLC (Senior Unsecured)			0,00%	maksuhäiriö 16.05.2019
HOCHTIEF AG	BBB-		1,33%	No
Iceland Bondco PLC	B+	B2	1,33%	No
Ineos Group Holdings SA	BB		1,33%	No
INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC	BB	Ba2	1,33%	No
Jaguar Land Rover Automotive PLC	BB	Ba2	1,33%	No
STMicroelectronics NV	BBB		1,33%	No
Stonegate Pub Company Financing PLC			1,33%	No
Stora Enso Oyj		Baa3	1,33%	No
Sunrise Communications Holdings SA			1,33%	No

Liite A – iTraxx Crossover Europe Series 26

Yhtiön nimi	Luottoluokitukset		Paino	Luottovastuutapahtuma
	S&P	Moody's		
Synlab Unsecured Bondco PLC	BB-	Caa1	1,33%	No
Techem AG			1,33%	No
Telecom Italia SpA	BB+	Ba1	1,33%	No
Tesco PLC	BBB-	Ba1	1,33%	No
Thyssenkrupp AG	BB-		1,33%	No
Trionista HoldCo GmbH			1,33%	No
TUI AG	CCC+	Ba2	1,33%	No
Unilabs SubHolding AB (publ)	CCC+		1,33%	No
Unitymedia GmbH		B3	1,33%	No
UPC Holding BV	BB-	B2	1,33%	No
Virgin Media Finance PLC	BB-		1,33%	No
Care UK Health and Social Care Plc (Subordinated)			1,33%	No
LADBROKES CORAL GROUP LTD (Senior Unsecured)			1,33%	No
Leonardo SpA	BB+	Ba1	1,33%	No
Lock Lower Holding AS			1,33%	No
Louis Dreyfus Company BV	BBB-		1,33%	No
Vue International Bidco PLC	CCC+		1,33%	No
Wind Acquisition Finance SA			1,33%	No
Ziggo Bond Company B.V. (Senior Unsecured)	B		1,33%	No
Air France KLM SA			1,33%	No
Altice Finco SA	B-	B3	1,33%	No
Anglo American PLC	BBB		1,33%	No
ArceorMittal SA	BBB-		1,33%	No
Ardagh Packaging Finance PLC	CCC+		1,33%	No
Premier Foods Finance PLC	B		1,33%	No
Repsol SA	BBB	Baa2	1,33%	No
Rexel SA	BB		1,33%	No
J Sainsbury PLC			1,33%	No
Loxam SA (Subordinated)			1,33%	No
Deutsche Lufthansa AG	BB-		1,33%	No
Matalan Finance PLC			0,00%	konkurssi 12.08.2020

Vastuuvapauslauseke

Tämä raportti perustuu Danske Bank A/S tekemiin arvioihin ja mielipiteisiin. Niiden perustana olevat tiedot on koottu Danske Bank A/S luotettavina pitämistä julkisista lähteistä. Danske Bank A/S tai niiden kanssa samaan konserniin kuuluvat yhtiöt taikka niiden palveluksessa olevat henkilöt eivät takaa esitettyjen tietojen, arvioiden ja mielipiteiden oikeellisuutta tai täydellisyyttä eivätkä vastaa mistään suorista tai epäsuorista kuluista, vahingoista tai menetyksistä, joita raportin tai sen sisältämien tietojen käyttö mahdollisesti voi aiheuttaa. Raportissa kuvattu lainan tuoton historiallinen kehitys ei ole tae tulevasta. Raportissa annetut mielipiteet ja arviot edustavat Danske Bank A/S mielipiteitä ja arvioita raportin julkaisuhetkellä ja niitä voidaan ilmoittamatta muuttaa. Tätä raporttia ei voida missään tilanteessa pitää arvopapereiden myynti- tai ostopaperien tai kehotuksena arvopaperi- tai muuhun kaupankäyntiin.