

SPAX Kreditkorg

RB411K

Avkastningen i "SPAX Kreditkorg" avseende första året är förutbestämd till 6,65%. Avkastningen för de därefter följande åren - så länge "SPAX Kreditkorg" är utestående - är relaterad till kreditrisken i en portfölj bestående av 249 bolag från ett flertal länder och verksamma inom ett flertal olika branscher. Den kreditrelaterade avkastningen uppgår till mellan 0 och 6,65 procent beroende på antal inträffade skadade kredithändelser. Banken äger rätt att återbetala "SPAX Kreditkorg" i sin helhet på valfri förfalldag för avkastning. Ytterligare beskrivning av hur avkastningen beräknas återfinns i emissionsbilagan för lån 411.

De lån som ingår i kreditportföljen framgår av sidan 2 - 6 i detta faktablad.

Den 17 juli 2006 gjordes en avknoppning av verksamheten fast telefoni i Alltel Corporation till Windstream Corporation, vilket innebär att det senare bolaget tillkom som Portföljforetag samma dag. Verizon Global Funding Corp har fusionerats med Verizon Communications Inc. På grund av avknoppning av verksamhet ersattes Verizon Communications Inc med Idearc Inc. den 17 november 2006

Emittent	FöreningsSparbanken AB
Börskod	FSPOKR11
VP-kod	RB411K
ISIN-nummer	SE0001552050
Nominellt belopp	Multiplar av 10 000 kronor
Startdag för kreditriskexponering	2005-12-09
Likviddag	2005-12-09
Slutdag för kreditriskexponering	2012-11-19
Återbetalningsdag	2012-12-10
Avkastning	Första året 6,65 %, sedan beroende av antalet kredithändelser i korgen, dock högst 6,65 %
Förfalldag för avkastning	10 december under vart och ett av åren 2006-2012.
Ursprunglig maximal kreditriskrelaterad kupong efter första året	6,65%
Antal kredithändelser hittills	6
Förtida återbetalning	Banken kan välja att återbetala "SPAX Kreditkorg" på valfri förfalldag för avkastning.
Emissionskurs	100%
Återbetalningskurs	100%
Portföljforetag	Se sidan 2 till 6
Marknad	249 företag från 16 länder.
Valutakursrisk	Nej
Börsregistrering	Ja

2008-09-07, Kredithändelse i FEDERAL HOME LOAN MORTGAGE CORPORATION (Freddie Mac)

2008-09-07, Kredithändelse i FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION (Fannie Mae)

2008-09-26, Kredithändelse i WASHINGTON MUTUAL, INC.

2009-03-31, Kredithändelse i IDEARC INC.

2009-06-15, Kredithändelse i THOMSON

2009-11-01, Kredithändelse i CIT GROUP INC

Värdering per 2012-11-30

Portföljstämningdagar	Kupong utbetalningsdag	Utbetald kupong	Teoretisk framtida årlig kupong ²⁾	
2006-11-26	2006-12-10	1	6,65%	
2007-11-26	2007-12-10	2	6,65%	
2008-11-26	2008-12-10	3	0,00%	
2009-11-26	2009-12-10	4	0,00%	
2010-11-26	2010-12-10	5	0,00%	
2011-11-26	2011-12-10	6	0,00%	
2012-11-26	2012-12-10	7	0,95%	0,95%
Slutvärde	100,95%			

²⁾ "Teoretisk framtida årlig kupong" anger vilken avkastning kreditobligationen skulle ge fram till förfalldagen baserat på antalet kredithändelser hittills och förutsatt att inga ytterligare förändringar sker fram till förfalldagen.

Portföljsammansättning

Nedan visas den av Banken på startdagen fastställda portföljen.

Företag	Land
ABN AMRO BANK N.V.	Holland
AEGON N.V.	Holland
ALLIANZ AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland
AVIVA PLC	England
AXA	Frankrike
BANCA INTESA S.P.A.	Italien
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA S.P.A.	Italien
BANCO COMERCIAL PORTUGUES, S.A.	Portugal
BANCO ESPIRITO SANTO, S.A.	Portugal
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	Spanien
BARCLAYS BANK PLC	England
BAYERISCHE HYPO- UND VEREINSBANK AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland
CAPITALIA S.P.A.	Italien
COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland
DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland
DRESDNER BANK AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG AG	Tyskland
UNICREDITO ITALIANO SOCIETA PER AZIONI	Italien
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT A.G.	Tyskland
SANPAOLO IMI S.P.A.	Italien
ASSICURAZIONI GENERALI - SOCIETA PER AZIONI	Italien
SWISS REINSURANCE COMPANY	Schweiz
THE GOVERNOR AND COMPANY OF THE BANK OF SCOTLAND	England
THE ROYAL BANK OF SCOTLAND PUBLIC LIMITED COMPANY	England
ZURICH INSURANCE COMPANY	Schweiz
AKTIEBOLAGET VOLVO	Sverige
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland
COMPAGNIE FINANCIERE MICHELIN	Schweiz
CONTINENTAL AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland
DAIMLERCHRYSLER AG	Tyskland
GKN HOLDINGS PLC	England
PEUGEOT SA	Frankrike
RENAULT	Frankrike
VALEO	Frankrike
VOLKSWAGEN AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland
ACCOR	Frankrike
AKTIEBOLAGET ELECTROLUX	Sverige
ALTADIS, SA	Spanien
BOOTS GROUP PLC	England
BRITISH AMERICAN TOBACCO P.L.C.	England
CADBURY SCHWEPPE'S PUBLIC LIMITED COMPANY	England
CARREFOUR	Frankrike
CASINO GUICHARD-PERRACHON	Frankrike
COMPASS GROUP PLC	England
DEUTSCHE LUFTHANSA AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland
DIAGEO PLC	England
DIXONS GROUP PLC	England
GALLAHER GROUP PLC	England
GROUPE AUCHAN	Frankrike
GROUPE DANONE	Frankrike
GUS PLC	England

Företag	Land	
HILTON GROUP PLC	England	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	England	
KINGFISHER PLC	England	
KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRONICS N.V.	Holland	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	Frankrike	
MARKS AND SPENCER P.L.C.	England	
METRO AG	Tyskland	
PPR	Frankrike	
SAFEWAY LIMITED	England	
SODEXHO ALLIANCE	Frankrike	
TATE & LYLE PUBLIC LIMITED COMPANY	England	
TESCO PLC	England	
THOMSON	Frankrike	Kredithändelse 2009-06-15
UNILEVER N.V.	Holland	
BP P.L.C.	England	
E.ON AG	Tyskland	
EDISON S.P.A.	Italien	
EDP - ELECTRICIDADE DE PORTUGAL, S.A.	Portugal	
ELECTRICITE DE FRANCE	Frankrike	
ENDESA, S.A.	Spanien	
ENEL S.P.A.	Italien	
ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland	
FORTUM OYJ	Finland	
IBERDROLA, SOCIEDAD ANONIMA	Spanien	
NATIONAL GRID COMPANY PLC	England	
REPSOL YPF S.A.	Spanien	
RWE AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland	
SCOTTISH POWER UK PLC	England	
SUEZ	Frankrike	
TECHNIP	Frankrike	
UNION FENOSA, S.A.	Spanien	
UNITED UTILITIES PLC	England	
VATTENFALL AKTIEBOLAG	Sverige	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	Frankrike	
ANGLO AMERICAN PLC	England	
ADECCO S.A.	Schweiz	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE COMPANY EADS N.V.	Frankrike	
AKZO NOBEL N.V.	Holland	
BAA PLC	England	
BAE SYSTEMS PLC	England	
BAYER AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland	
FINMECCANICA S.P.A.	Italien	
GLENCORE INTERNATIONAL AG	Schweiz	
IMPERIAL CHEMICAL INDUSTRIES PLC	England	
LAFARGE	Frankrike	
LINDE AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland	
ARCELOR FINANCE	Luxembourg	
RENTOKIL INITIAL PLC	England	
ROLLS-ROYCE PLC	England	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	Frankrike	
SIEMENS AKTIENGESELLSCHAFT	Tyskland	
STORA ENSO OYJ	Finland	
THYSSENKRUPP AG	Tyskland	
UPM-KYMMENE OYJ	Finland	
BERTELSMANN AG	Tyskland	
BRITISH TELECOMMUNICATIONS PUBLIC LIMITED COMPANY	England	

Företag	Land
CARLTON COMMUNICATIONS PLC	England
DEUTSCHE TELEKOM AG	Tyskland
FRANCE TELECOM	Frankrike
HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	Grekland
SOCIETE ANONYME	
KONINKLIJKE KPN N.V.	Holland
MMO2 PLC	England
NOKIA OYJ	Finland
REED ELSEVIER PLC	England
REUTERS GROUP PLC	England
STMICROELECTRONICS N.V.	Holland
TDC A/S	Danmark
TELECOM ITALIA SPA	Italien
TELEFONICA, S.A.	Spanien
VIVENDI UNIVERSAL	Frankrike
VNU N.V.	Holland
VODAFONE GROUP PUBLIC LIMITED COMPANY	England
WOLTERS KLUWER N.V.	Holland
WPP GROUP PLC.	England
ALCOA INC.	USA
ALBERTSON'S, INC.	USA
ACE LIMITED	Bermuda
AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY, INC.	USA
AETNA INC.	USA
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP, INC.	USA
INTERNATIONAL LEASE FINANCE CORPORATION	USA
ALCAN INC.	Kanada
THE ALLSTATE CORPORATION	USA
AMGEN INC.	USA
ANADARKO PETROLEUM CORPORATION	USA
ALLTEL CORPORATION	USA
WINDSTREAM CORPORATION	USA
AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC	USA
AMERICAN EXPRESS COMPANY	USA
AUTOZONE, INC.	USA
BOEING CAPITAL CORPORATION	USA
BAXTER INTERNATIONAL INC.	USA
BELLSOUTH CORPORATION	USA
BRISTOL-MYERS SQUIBB COMPANY	USA
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORPORATION	USA
CONAGRA FOODS, INC.	USA
CARDINAL HEALTH, INC.	USA
CATERPILLAR INC.	USA
THE CHUBB CORPORATION	USA
CARNIVAL CORPORATION	USA
COUNTRYWIDE HOME LOANS, INC.	USA
CLEAR CHANNEL COMMUNICATIONS, INC.	USA
CENDANT CORPORATION	USA
CONSTELLATION ENERGY GROUP, INC.	USA
CIGNA CORPORATION	USA
CIT GROUP INC.	USA
COMCAST CABLE COMMUNICATIONS, LLC	USA
CINGULAR WIRELESS LLC	USA
CAPITAL ONE BANK	USA
CONOCOPHILLIPS	USA
COX COMMUNICATIONS, INC.	USA

fr o m 2006-07-17

Kredithändelse 2009-11-01

Företag	Land	
CAMPBELL SOUP COMPANY	USA	
COMPUTER SCIENCES CORPORATION	USA	
CSX CORPORATION	USA	
CENTURYTEL, INC.	USA	
CENTEX CORPORATION	USA	
CVS CORPORATION	USA	
DOMINION RESOURCES, INC.	USA	
E. I. DU PONT DE NEMOURS AND COMPANY	USA	
DEERE & COMPANY	USA	
THE WALT DISNEY COMPANY	USA	
THE DOW CHEMICAL COMPANY	USA	
DUKE ENERGY CORPORATION	USA	
DEVON ENERGY CORPORATION	USA	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	USA	
EOP OPERATING LIMITED PARTNERSHIP	USA	
FEDERATED DEPARTMENT STORES, INC.	USA	
FIRSTENERGY CORP.	USA	
FEDERAL HOME LOAN MORTGAGE CORPORATION	USA	Kredithändelse 7 september 2008
FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION	USA	Kredithändelse 7 september 2008
SPRINT CORPORATION	USA	
GENERAL ELECTRIC CAPITAL CORPORATION	USA	
GENERAL MILLS, INC.	USA	
GOODRICH CORPORATION	USA	
HALLIBURTON COMPANY	USA	
HARRAH'S OPERATING COMPANY, INC.	USA	
THE HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP, INC.	USA	
HILTON HOTELS CORPORATION	USA	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC.	USA	
HEWLETT-PACKARD COMPANY	USA	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORPORATION	USA	
INTERNATIONAL PAPER COMPANY	USA	
INGERSOLL-RAND COMPANY	Bermuda	
JONES APPAREL GROUP, INC.	USA	
NORDSTROM, INC.	USA	
KRAFT FOODS INC.	USA	
THE KROGER CO.	USA	
LENNAR CORPORATION	USA	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	USA	
LOEWS CORPORATION	USA	
SOUTHWEST AIRLINES CO.	USA	
MARRIOTT INTERNATIONAL, INC.	USA	
MBIA INSURANCE CORPORATION	USA	
MCDONALD'S CORPORATION	USA	
MCKESSON CORPORATION	USA	
METLIFE, INC.	USA	
ALTRIA GROUP, INC.	USA	
MOTOROLA, INC.	USA	
MEADWESTVACO CORPORATION	USA	
NORTHROP GRUMMAN CORPORATION	USA	
NATIONAL RURAL UTILITIES COOPERATIVE FINANCE CORPORATION	USA	
NORFOLK SOUTHERN CORPORATION	USA	
NEWELL RUBBERMAID INC.	USA	
NEWS AMERICA INCORPORATED	USA	
OMNICOM GROUP INC.	USA	
PROGRESS ENERGY, INC.	USA	
PULTE HOMES, INC.	USA	

Företag	Land	
TRANSOCEAN INC.	USA	
ROHM AND HAAS COMPANY	USA	
RAYTHEON COMPANY	USA	
SBC COMMUNICATIONS INC.	USA	
SIMON PROPERTY GROUP, L.P.	USA	
SEMPRA ENERGY	USA	
SUPERVALU INC.	USA	
SAFEWAY INC.	USA	
TARGET CORPORATION	USA	
TYSON FOODS, INC.	USA	
TIME WARNER INC.	USA	
TEXTRON FINANCIAL CORPORATION	USA	
UNION PACIFIC CORPORATION	USA	
VIACOM INC.	USA	
VALERO ENERGY CORPORATION	USA	
IDEARC INC.	USA	Kredithändelse 31 mars 2009
WELLS FARGO & COMPANY	USA	
WHIRLPOOL CORPORATION	USA	
WASHINGTON MUTUAL, INC.	USA	Kredithändelse 26 september 2008
WAL-MART STORES, INC.	USA	
WEYERHAEUSER COMPANY	USA	
WYETH	USA	
XL CAPITAL LTD	Bermuda	
THE GAP, INC.	USA	
IAC/INTERACTIVECORP	USA	
KNIGHT-RIDDER, INC.	USA	
LIMITED BRANDS, INC.	USA	
MARSH & MCLENNAN COMPANIES, INC.	USA	
RADIOSHACK CORPORATION	USA	
SARA LEE CORPORATION	USA	
TOLL BROTHERS, INC.	USA	
SABRE HOLDINGS CORPORATION	USA	