

SPAX Fästningen II

AIO504B

Avkastningen i SPAX Fästningen II är beroende av utvecklingen av en aktiekorg bestående av 15 bolag som är involverade i utvecklingen av energitvinning, såsom kärnkraft, vind- och vattenkraft, solenergi etc. Aktiekorgen är likaviktad och varje aktie påverkar aktiekorgens vikt med 1/15 vardera.

Avkastningen, som beräknas på nominellt belopp, är beroende av aktiekorgens procentuella utveckling och deltagandegraden. Utvecklingen av index mäts i procent och motsvaras av förändringen mellan start- och slutvärde. Startvärde fastställs utifrån aktiekorgens stängningsvärde på startdagen. Slutvärde beräknas som ett genomsnitt av varje akties värde avläst en gång i månaden under löptidens sista år. Vid beräkning av aktiekorgens slutvärde kommer varje enskild akties värdeökning att maximalt uppgå till 80 procent. Deltagandegraden visar hur stor del av kursuppgången du har rätt till. Oavsett aktiekorgens utveckling återbetalar Banken nominellt belopp på återbetalningsdagen.

Emittent	Swedbank AB
Börskod	SWE0VAR4
VP-kod	AIO504B
ISIN-nummer	SE0002372219
Nominellt belopp	1 000 kr
Börspost	5 obligationer, dvs nominellt 5 000 kronor
Fastställd emissionsvolym	5 900 000 kr
Emissionskurs	110%
Deltagandegrad	190%
Marknad	Världen
Dag för fastställande av startvärde	2008-04-04
Dag för fastställande av slutvärde	2013-04-03
Återbetalningsdag	2013-04-17
Ersättningsvärde	80%
Övrigt	-

Värdering per 2013-04-08

Aktier	Q-CELLS AG	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	RIO TINTO PLC	BHP BILLITON PLC	FORTUM OYJ	ELECTRICITE DE FRANCE	SOLARWORLD AG	EXELON CORP	ENTERGY CORP	SIEMENS AG-REG	RWE AG	AMERICAN PLC	CAMECO CORP	DENISON MINES CORP	ENERGY FUELS INC	USEC INC	Korgvärde
Startkurs	53,20 ⁴⁾	507,67	4 542,47 ³⁾	1 568,33	25,24	59,70	32,47	94,44 ⁶⁾	111,19	71,38	80,7278 ⁵⁾	3 089,00	34,73	6,7167 ⁷⁾	6,7167 ⁷⁾	4,87	
Vikt	6,667%	6,667%	6,667%	6,667%	6,667%	6,667%	6,667%	6,667%	6,667%	6,667%	6,667%	6,667%	6,667%	3,166%	3,501%	6,667%	100
Mättdpunkt ¹⁾																	
2012-04-03	0,136	54,95	3630,50	1934,50	17,88	17,69	2,24	38,93	66,94	75,68	35,52	2339,50	20,69	1,30	0,25	1,16	49,42
2012-05-03	0,145	44,58	3363,00	1996,00	16,27	16,31	1,70	38,82	65,16	68,90	32,16	2365,00	22,71	1,57	0,28	0,84	47,73
2012-06-06	0,137	31,54	2899,50	1776,00	14,58	15,59	1,44	37,45	65,20	65,12	28,72	2091,00	20,17	1,33	0,24	0,80	43,36
2012-07-03	0,148	29,62	3157,00	1870,00	15,36	17,39	1,42	37,41	68,53	67,50	33,33	2154,50	23,12	1,22	0,17	1,02	46,23
2012-08-03	0,096	27,79	3030,00	1918,00	13,98	16,50	1,23	38,47	72,71	72,40	32,43	1900,50	20,68	1,32	0,21	0,77	45,13
2012-09-03	0,058	44,35	2795,50	1855,00	14,86	16,41	1,17	36,11	68,62	75,66	33,80	1773,00	21,18	1,40	0,20	0,61	44,59
2012-10-03	0,061	37,90	2934,50	1943,00	14,11	16,82	1,40	35,65	69,78	79,00	35,78	1818,00	19,17	1,42	0,19	0,72	45,35
2012-11-05	0,039	31,55	3145,00	1991,50	14,67	16,25	1,35	32,01	67,90	79,33	35,08	1933,00	18,25	1,23	0,17	0,69	45,39
2012-12-03	0,038	29,10	3120,00	1965,50	14,16	14,30	0,99	29,31	63,39	79,46	32,02	1742,50	18,03	1,09	0,15	0,54	43,35
2013-01-03	0,038	34,22	3658,50	2199,50	14,45	14,19	1,25	30,06	64,44	84,03	31,62	2014,50	19,74	1,23	0,17	0,57	46,86
2013-02-04	0,042	34,33	3615,00	2168,00	13,90	13,92	1,07	30,75	64,10	77,20	27,48	1924,50	21,75	1,45	0,18	0,58	45,81
2013-03-04	0,037	40,20	3316,00	2037,00	14,71	14,34	1,22	31,34	62,95	79,79	28,85	1849,00	21,06	1,24	0,15	0,50	44,99
2013-04-03	0,017	44,10	3024,50	1900,00	16,26	15,29	0,89	34,50	65,00	83,80	29,06	1650,00	19,77	1,27	0,15	0,35	44,35
Respektive akties genomsnittliga slutkurs	0,08	37,25	3199,15	1965,69	15,01	15,77	1,34	34,68	66,52	75,99	31,99	1965,77	20,49	1,31	0,19	0,70	
Respektive akties procentuella utveckling	-99,86%	-92,66%	-29,57%	25,34%	-40,52%	-73,59%	-95,88%	-63,28%	-40,18%	6,46%	-60,38%	-36,36%	-41,02%	-80,45%	-97,15%	-85,56%	-54,42%
Respektive akties procentuella utveckling justerat för tak på 80%	-99,86%	-92,66%	-29,57%	25,34%	-40,52%	-73,59%	-95,88%	-63,28%	-40,18%	6,46%	-60,38%	-36,36%	-41,02%	-80,45%	-97,15%	-85,56%	-51,02%
Aktuellt korgvärde	45,58																
Aktiekorgens kursutveckling inkl ersättningsvärde	-51,02%																
Teoretisk framtida avkastning ²⁾	0,00%																
Slutvärde	100,00%																

¹⁾ Om datumet under "Mättdpunkt" är ett framtida datum är värdet som anges det senast avlästa indexvärdet.

²⁾ "Teoretisk framtida avkastning" anger vilken avkastning aktieindexobligationen skulle ge på förfalldagen baserat på kursutvecklingen hittills och förutsatt att inga ytterligare förändringar sker fram till förfalldagen.

³⁾ Justering pga nyemission 2009-06-17. Tidigare startkurs 5 498,67.

⁴⁾ Justering pga nyemission 2010-09-29. Tidigare startkurs 65,47.

⁵⁾ Justering av startkurs pga nyemission den 8 december 2011. Tidigare startkurs 80,997.

⁶⁾ Justering av startkurs och aktie pga företagsuppköp den 13 mars 2012. Tidigare startkurs 87,833, tidigare aktie CONSTELLATION ENERGY GROUP.

⁷⁾ Justering pga avknoppning 2012-06-29. Denison Mines Corp räknas nu som 1 x (Denison Mines Corp) + 1,106 x (Energy Fuels Inc).