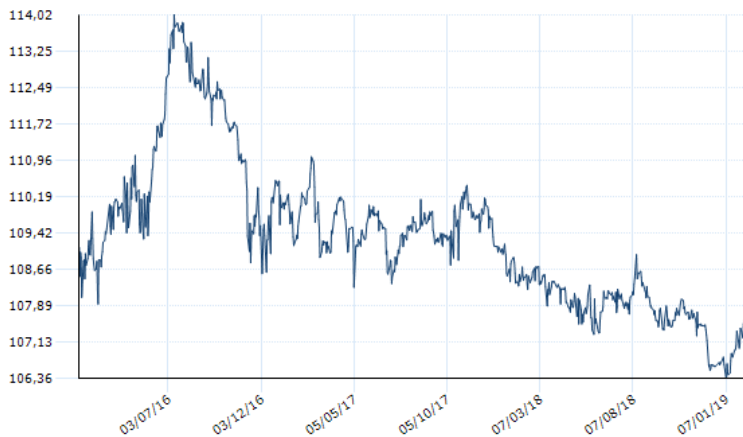


Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Molto liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
107,65 EUR	Basf SE	05/12/2022	2,000%	-0,011%	-0,537%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	107,65
Rendimento lordo	-0,01115
Rendimento netto	-0,53712
Cedola in corso	2,00000
Rateo lordo	0,39452
Rateo netto	0,29195
Vita residua	3,80548
Duration modificata	3,69295
Convessità	17,58306
Cedola successiva	2,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Basf SE
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.250.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	05/12/2012
Prezzo emissione	98,8220
Decorrenza prima cedola regolare	05/12/2012
Tasso annuale	2,0000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	05/12/2022
Data estinzione	05/12/2022
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	109,7100	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	106,9100	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	107,2400	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	107,4100	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	107,4700	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	107,8800	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	107,4950	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	107,4100	EUR
Euro TLX	13/02/2019	107,6500	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
05/12/2019	2,000	2,000	Certa	1.250.000.000	0	365
05/12/2020	2,000	2,000	Certa	1.250.000.000	0	366
05/12/2021	2,000	2,000	Certa	1.250.000.000	0	365
05/12/2022	2,000	2,000	Certa	1.250.000.000	1.250.000.000	365

Annotazioni

Callable fino al 04/12/2022 con 'make-whole' premium legato al Comparable Benchmark Yield + 15 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	05/12/2012	04/12/2022	100	30