

COMMERZBANK AG 4.00% 09/20 / DE000CZ302M3
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
105,87 EUR	CommerzBank	16/09/2020	4,000%	0,278%	-0,715%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	105,87
Rendimento lordo	0,27847
Rendimento netto	-0,71532
Cedola in corso	4,00000
Rateo lordo	1,66575
Rateo netto	1,23266
Vita residua	1,58630
Duration modificata	1,54476
Convessità	3,96251
Cedola successiva	4,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	CommerzBank
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	16/09/2010
Prezzo emissione	99,7970
Decorrenza prima cedola regolare	16/09/2010
Tasso annuale	4,0000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	16/09/2020
Data estinzione	16/09/2020
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	13/02/2019	105,6090	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	105,7300	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	105,7400	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	105,7400	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	105,7300	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	105,7400	EUR
Euro TLX	13/02/2019	105,8700	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
16/09/2019	4,000	4,000	Certa	1.000.000.000	0	365
16/09/2020	4,000	4,000	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	366