

EDF SA 4.625 09/24 / FR0010800540

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
121,06 EUR	Electricite De France (EDF)	11/09/2024	4,625%	0,749%	-0,337%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	121,06
Rendimento lordo	0,74876
Rendimento netto	-0,33710
Cedola in corso	4,62500
Rateo lordo	1,98938
Rateo netto	1,47214
Vita residua	5,57534
Duration modificata	4,98187
Convessità	31,47592
Cedola successiva	4,62500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Electricite De France (EDF)
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.500.000.000
Nominale obbligazione	50.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	11/09/2009
Prezzo emissione	98,8380
Decorrenza prima cedola regolare	11/09/2009
Tasso annuale	4,6250
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	11/09/2024
Data estinzione	11/09/2024
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	118,5000	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	121,0600	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	121,1700	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	121,0400	EUR
NYSE Euronext Paris	13/02/2019	120,0500	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	121,4100	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	121,0100	EUR
Euro TLX	13/02/2019	121,7500	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	121,9850	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
11/09/2019	4,625	4,625	Certa	2.500.000.000	0	365
11/09/2020	4,625	4,625	Certa	2.500.000.000	0	366
11/09/2021	4,625	4,625	Certa	2.500.000.000	0	365
11/09/2022	4,625	4,625	Certa	2.500.000.000	0	365
11/09/2023	4,625	4,625	Certa	2.500.000.000	0	365
11/09/2024	4,625	4,625	Certa	2.500.000.000	2.500.000.000	366