

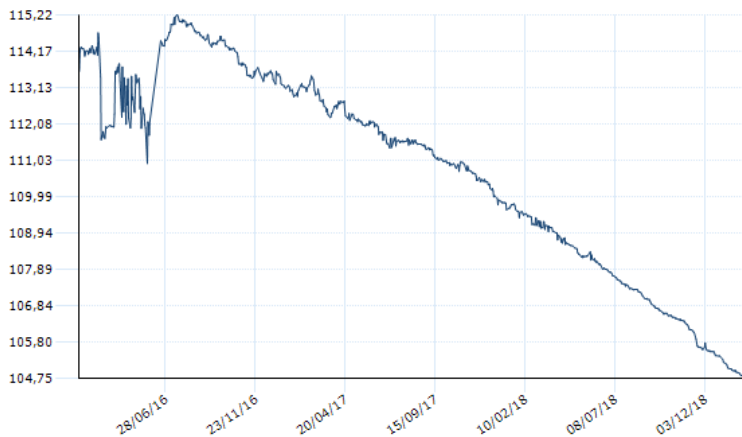
Grado di rischio calcolato

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
104,73 EUR	Alstom	18/03/2020	4,500%	0,134%	-0,985%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	104,73
Rendimento lordo	0,13363
Rendimento netto	-0,98482
Cedola in corso	4,50000
Rateo lordo	4,11781
Rateo netto	3,04718
Vita residua	1,08767
Duration modificata	1,04482
Convessità	2,17483
Cedola successiva	4,50000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	750.000.000
Nominale obbligazione	50.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	18/03/2010
Prezzo emissione	99,8730
Decorrenza prima cedola regolare	18/03/2010
Tasso annuale	4,5000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	18/03/2020
Data estinzione	18/03/2020
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	113,1300	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	104,7300	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	104,7300	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	104,7900	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	104,7900	EUR
NYSE Euronext Paris	13/02/2019	112,4900	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	104,9270	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	104,7900	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/03/2019	4,500	4,500	Certa	750.000.000	0	365
18/03/2020	4,500	4,500	Certa	750.000.000	750.000.000	366