

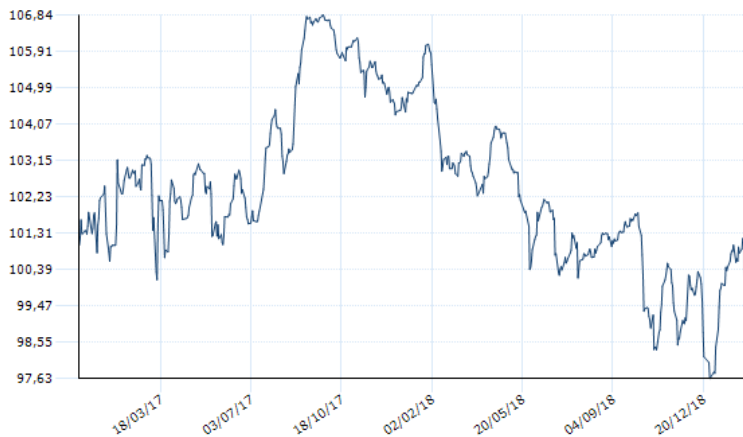
Grado di rischio calcolato

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
100,77 USD	FCA Fiat Chrysler Automobiles	15/04/2023	2,625%	5,101%	3,714%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,77
Rendimento lordo	5,10084
Rendimento netto	3,71420
Cedola in corso	2,62500
Rateo lordo	1,75000
Rateo netto	1,29500
Vita residua	4,16438
Duration modificata	3,55594
Convessità	16,98930
Cedola successiva	2,62500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	FCA Fiat Chrysler Automobiles
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	200.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	14/04/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	15/10/2015
Data Prorata	14/04/2015
Tasso annuale	5,2500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/04/2023
Data estinzione	15/04/2023
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	100,7700	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	100,9700	USD
Börse Berlin	13/02/2019	100,7200	USD
ExtraMOT	13/02/2019	101,5800	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,9700	USD
Euro TLX	13/02/2019	101,6000	USD
Hi-MTF	13/02/2019	101,8050	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/04/2019	5,250	2,625	Certa	1.500.000.000	0	182
15/10/2019	5,250	2,625	Certa	1.500.000.000	0	183
15/04/2020	5,250	2,625	Certa	1.500.000.000	0	183
15/10/2020	5,250	2,625	Certa	1.500.000.000	0	183
15/04/2021	5,250	2,625	Certa	1.500.000.000	0	182
15/10/2021	5,250	2,625	Certa	1.500.000.000	0	183
15/04/2022	5,250	2,625	Certa	1.500.000.000	0	182
15/10/2022	5,250	2,625	Certa	1.500.000.000	0	183
15/04/2023	5,250	2,625	Certa	1.500.000.000	1.500.000.000	182

Annotazioni

Callable fino al 14/04/2023 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 50 bp. (prezzo rimborso = 101)

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	14/04/2015	14/04/2023	100	30