

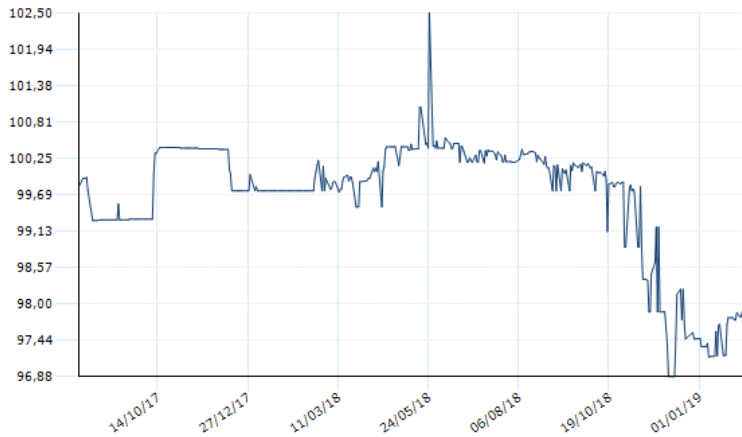
KRAFT HEINZ CO USDLiber3m 08/22 / US50077LAQ95
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Poco liquido

12/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
97,76 USD	Kraft Heinz Foods	10/08/2022	0,860%	4,343%	3,373%


Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	97,76
Rendimento lordo	4,34283
Rendimento netto	3,37346
Cedola in corso	0,85970
Rateo lordo	0,02931
Rateo netto	0,02169
Vita residua	3,48767
Duration modificata	0,22350
Convessità	0,27345
Cedola successiva	0,89650
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Kraft Heinz Foods
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	10/08/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	10/08/2017
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	10/08/2022
Data estinzione	10/08/2022
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	12/02/2019	97,7600	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	98,2400	USD
Börse Berlin	12/02/2019	98,2400	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	98,2200	USD

Formula di indicizzazione

$$TV = (\text{USDLiber } 3m + 0,82) * \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg).}$$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
10/05/2019	0,000	0,860	Certa	500.000.000	0	88
12/08/2019	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	94
11/11/2019	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	91
10/02/2020	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	91
11/05/2020	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	91
10/08/2020	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	91
10/11/2020	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	92
10/02/2021	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	92
10/05/2021	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	89
10/08/2021	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	92
10/11/2021	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	92
10/02/2022	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	92
10/05/2022	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	0	89
10/08/2022	0,000	0,896	Prevista	500.000.000	500.000.000	92

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
10/08/2017	10/08/2022	USDLIBOR3M	1,000	0,820