

SHELL INT.FIN. BV 4.30% 09/19 / US822582AJ10
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
100,97 USD	Shell International Finance BV	22/09/2019	2,150%	2,631%	1,530%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,97
Rendimento lordo	2,63119
Rendimento netto	1,53010
Cedola in corso	2,15000
Rateo lordo	1,70806
Rateo netto	1,26396
Vita residua	0,60000
Duration modificata	0,57714
Convessità	0,90033
Cedola successiva	2,15000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Shell International Finance BV
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	22/09/2009
Prezzo emissione	99,6540
Decorrenza prima cedola regolare	22/09/2009
Tasso annuale	4,3000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	22/09/2019
Data estinzione	22/09/2019
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	110,5000	USD
Frankfurter Börse	13/02/2019	100,8300	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,8500	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	100,8800	USD
Börse Berlin	13/02/2019	100,9000	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,8800	USD
Euro TLX	13/02/2019	100,9700	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
22/03/2019	4,300	2,150	Certa	2.000.000.000	0	181
22/09/2019	4,300	2,150	Certa	2.000.000.000	2.000.000.000	184

Annotazioni

Callable fino al 21/09/2019 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 15 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	22/09/2009	21/09/2019	100	30