

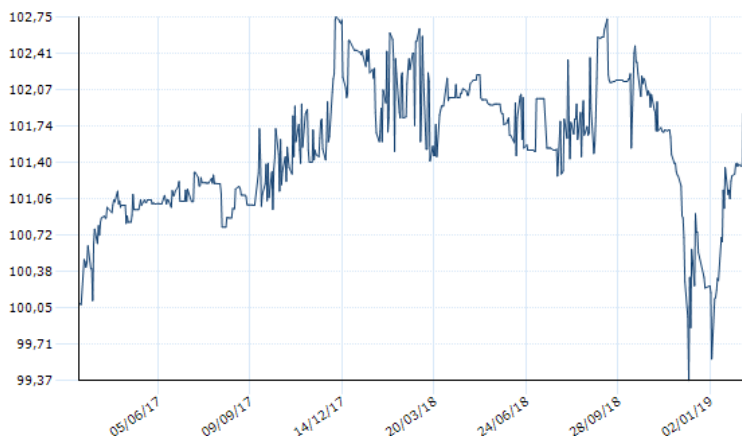
VERIZON COMMUNIC. USDLib3a 03/22 / US92343VDX91
Grado di rischio calcolato

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
101,35 USD	Verizon Communications	16/03/2022	0,958%	3,360%	2,363%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	101,35
Rendimento lordo	3,35979
Rendimento netto	2,36328
Cedola in corso	0,95760
Rateo lordo	0,63136
Rateo netto	0,46721
Vita residua	3,08219
Duration modificata	0,15297
Convessità	0,17637
Cedola successiva	0,94400
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Verizon Communications
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.400.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	16/03/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	16/03/2017
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	16/03/2022
Data estinzione	16/03/2022
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	100,9300	USD
Börse Düsseldorf	12/02/2019	100,9400	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	100,9200	USD
Börse Berlin	12/02/2019	100,9200	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	100,9200	USD
Euro TLX	13/02/2019	101,3500	USD

Formula di indicizzazione

$$TV = (\text{USDLibor3m} + 1.00) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg)}$$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/03/2019	0,000	0,958	Certa	1.400.000.000	0	91
17/06/2019	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	0	91
16/09/2019	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	0	91
16/12/2019	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	0	91
16/03/2020	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	0	91
16/06/2020	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	0	92
16/09/2020	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	0	92
16/12/2020	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	0	91
16/03/2021	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	0	90
16/06/2021	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	0	92
16/09/2021	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	0	92
16/12/2021	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	0	91
16/03/2022	0,000	0,944	Prevista	1.400.000.000	1.400.000.000	90

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
16/03/2017	16/03/2022	USDLIBOR3M	1,000	1,000