

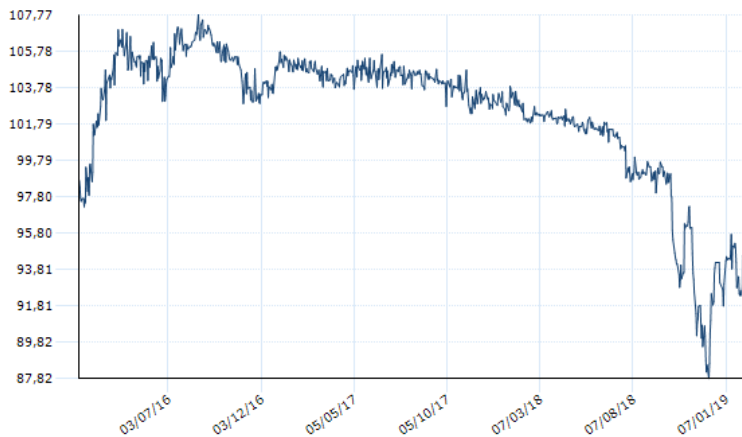
JAGUAR 5.625% 02/23 / USG50027AE42
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Poco liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
90,51 USD	Jaguar Land Rover PLC	01/02/2023	2,813%	8,668%	7,058%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	90,51
Rendimento lordo	8,66797
Rendimento netto	7,05752
Cedola in corso	2,81250
Rateo lordo	0,21875
Rateo netto	0,16188
Vita residua	3,96438
Duration modificata	3,29342
Convessità	14,58792
Cedola successiva	2,81250
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Jaguar Land Rover PLC
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	150.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	28/01/2013
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	01/08/2013
Data Prorata	28/01/2013
Tasso annuale	5,6250
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/02/2023
Data estinzione	01/02/2023
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	87,9800 USD
Börse Berlin	13/02/2019	88,8270 USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	90,2790 USD
Euro TLX	13/02/2019	90,5100 USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/08/2019	5,625	2,813	Certa	500.000.000	0	181
01/02/2020	5,625	2,813	Certa	500.000.000	0	184
01/08/2020	5,625	2,813	Certa	500.000.000	0	182
01/02/2021	5,625	2,813	Certa	500.000.000	0	184
01/08/2021	5,625	2,813	Certa	500.000.000	0	181
01/02/2022	5,625	2,813	Certa	500.000.000	0	184
01/08/2022	5,625	2,813	Certa	500.000.000	0	181
01/02/2023	5,625	2,813	Certa	500.000.000	500.000.000	184

Annotazioni

L'Emittente ha la facoltà di rimborsare anticipatamente il titolo secondo le seguenti modalità:
 - in qualsiasi momento prima del 15.05.2016, oltre gli interessi maturati ma non ancora pagati, ad un prezzo pari al 100% del valore nominale più la differenza tra il valore attuale, alla data del rimborso anticipato, dei pagamenti futuri (cedole rimanenti e rimborso del valore nominale), scontati al tasso di rendimento di un titolo di Stato statunitense benchmark (Treasury Rate) avente pari scadenza più 0.50%, meno il valore nominale;
 - in qualsiasi momento a partire dal 15.05.2016, oltre gli interessi maturati ma non ancora pagati, ad un prezzo che varia a seconda della data in cui avviene il rimborso come di seguito indicato:

dal 15.05.2016 al 14.05.2017 104.063%
 dal 15.05.2017 al 14.05.2018 102.708%
 dal 15.05.2018 al 14.05.2019 101.354%
 dal 15.05.2019 al 15.05.2021 100%

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	28/01/2013	31/01/2018	100	30
Call dal	01/02/2018	31/01/2019	102,813	30
Call dal	01/02/2019	31/01/2020	101,875	30
Call dal	01/02/2020	31/01/2021	100,938	30
Call dal	01/02/2021	31/01/2023	100	30