

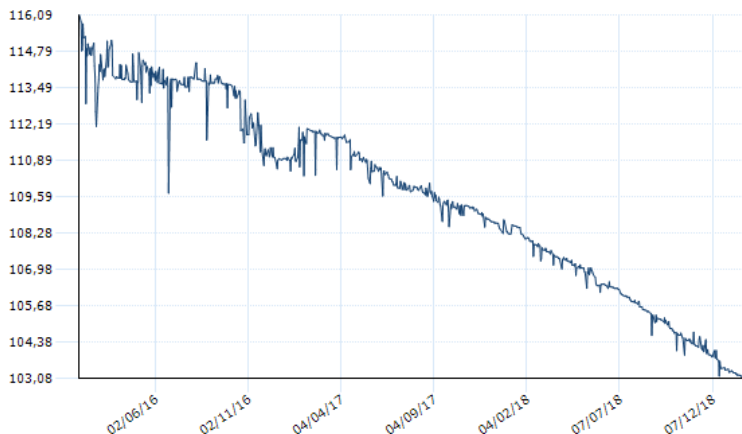
**COMMERZBANK AG CmsEUR30a 08/19 / XS0100221349**
**Grado di rischio calcolato**

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
102,7 EUR	CommerzBank	30/08/2019	5,250%	0,208%	-1,079%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	102,7
Rendimento lordo	0,20822
Rendimento netto	-1,07887
Cedola in corso	5,25000
Rateo lordo	2,43082
Rateo netto	1,79881
Vita residua	0,53699
Duration modificata	0,53588
Convessità	0,82193
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	CommerzBank
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	25.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	30/08/1999
Prezzo emissione	101,4000
Decorrenza prima cedola regolare	30/08/1999
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/365
Cedola minima %	5,25
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	30/08/2019
Data estinzione	30/08/2019
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	13/02/2019	102,5400	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	102,6100	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	102,5000	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	102,6330	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	102,6100	EUR
Euro TLX	13/02/2019	102,7000	EUR

**Formula di indicizzazione**
 $TV = (82\% * CMSEUR30a) \text{ (puntuale 2gg)}$ 
**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
30/08/2019	0,000	5,250	Certa	25.000.000.000	25.000.000.000	365

**Indicizzazione cedole**

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
30/08/1999	30/08/2019	IRS30YEUR	0,820	0,000