

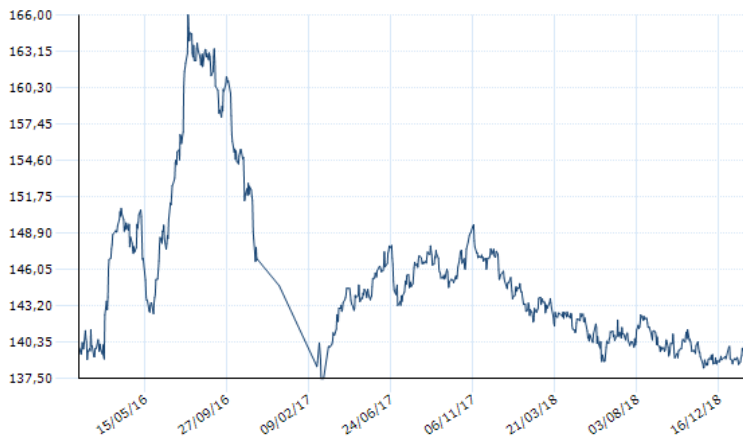
Grado di rischio calcolato

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
143,24 EUR	Electricite De France (EDF)	21/02/2033	5,625%	2,044%	0,865%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	143,24
Rendimento lordo	2,04374
Rendimento netto	0,86488
Cedola in corso	5,62500
Rateo lordo	5,53253
Rateo netto	4,09408
Vita residua	14,02740
Duration modificata	10,17324
Convessità	135,37404
Cedola successiva	5,62500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Electricite De France (EDF)
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	850.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	21/02/2003
Prezzo emissione	98,8980
Decorrenza prima cedola regolare	21/02/2003
Tasso annuale	5,6250
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	21/02/2033
Data estinzione	21/02/2033
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	133,0500	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	143,2400	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	144,1100	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	143,7400	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	144,0400	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	144,6100	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	144,8000	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	143,5100	EUR
Euro TLX	13/02/2019	144,6500	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	144,0000	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
21/02/2019	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
21/02/2020	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
21/02/2021	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	366
21/02/2022	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
21/02/2023	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
21/02/2024	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
21/02/2025	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	366
21/02/2026	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
21/02/2027	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
21/02/2028	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
21/02/2029	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	366
21/02/2030	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
21/02/2031	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
21/02/2032	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
21/02/2033	5,625	5,625	Certa	850.000.000	850.000.000	366