

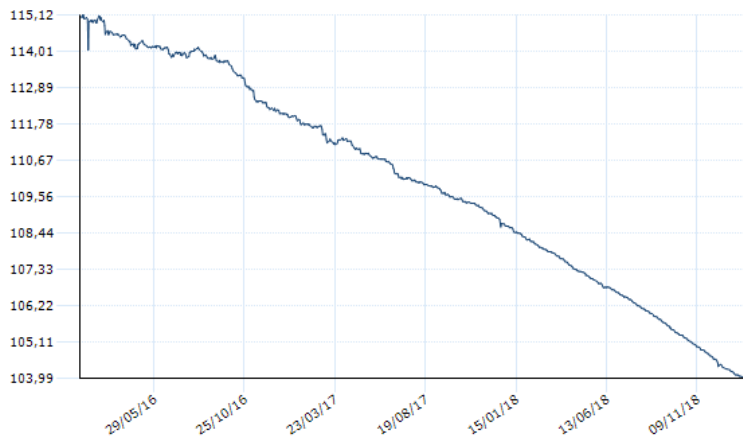
BK OF SCOTLAND Cov 3.875% 02/20 / XS0212074388
Grado di rischio calcolato

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
103,92 EUR	Bank of Scotland	07/02/2020	3,875%	-0,126%	-1,100%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	103,92
Rendimento lordo	-0,12598
Rendimento netto	-1,10017
Cedola in corso	3,87500
Rateo lordo	0,08493
Rateo netto	0,06285
Vita residua	0,97808
Duration modificata	0,97686
Convessità	1,93231
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Bank of Scotland
Tipo obbligazione	Covered Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.500.000.000
Nominale obbligazione	50.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	08/02/2005
Prezzo emissione	99,0250
Decorrenza prima cedola regolare	07/02/2006
Data Prorata	08/02/2005
Tasso annuale	3,8750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	07/02/2020
Data estinzione	07/02/2020
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	103,9200	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	103,9000	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	103,9180	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	103,9550	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	103,9180	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
07/02/2020	3,875	3,875	Certa	1.500.000.000	1.500.000.000	365

Annotazioni

Covered Bond.