

ASS. GENERALI sub TF+TV 06/Pe / XS0257010206
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 |
| 100,47 GBP | Assicurazioni Generali | 16/06/2050 | 6,269% | 4,385% | 3,153% |


Analisi

| | |
|------------------------|----------------------|
| Data ultima quotazione | 13/02/2019 |
| Data valutazione | 13/02/2019 |
| Data valuta | 15/02/2019 |
| Prezzo | 100,471 |
| Rendimento lordo | 4,38529 |
| Rendimento netto | 3,15348 |
| Cedola in corso | 6,26900 |
| Rateo lordo | 4,19078 |
| Rateo netto | 3,10118 |
| Vita residua | 31,35342 |
| Duration modificata | 8,56743 |
| Convessità | 81,96830 |
| Cedola successiva | 6,26900 |
| Mercato di riferimento | Bourse de Luxembourg |

Dati anagrafici principali

| | |
|-------------------|--------------------------------|
| Ente emittente | Assicurazioni Generali |
| Tipo obbligazione | Perpetual Preferred Securities |
| Tipo tasso | Tasso Fisso + Variabile |
| Divisa | GBP |
| Convertibilità | Nessuno |

Caratteristiche principali

| | |
|----------------------------------|-------------|
| Nominale circolante | 350.000.000 |
| Nominale obbligazione | 50.000,00 |
| Taglio minimo | 50.000,00 |
| Corso | Secco |
| Sottoscrizione | Regular |
| Data emissione | 16/06/2006 |
| Prezzo emissione | 100,0000 |
| Decorrenza prima cedola regolare | 16/06/2006 |
| Frequenza cedola | 1 |
| Base rateo cedola | ACT/ACT |
| Subordinato | SI |

Rimborso

| | |
|-----------------------------|-----------------|
| Tipo ammortamento | Unica Soluzione |
| Data 1° rimborso | 16/06/2050 |
| Data estinzione | 16/06/2050 |
| 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 |
|---------------------------|------------|----------|--------|
| LSE London Stock Exchange | 13/02/2019 | 101,0000 | GBP |
| Bourse de Luxembourg | 13/02/2019 | 100,4710 | GBP |

Formula di indicizzazione

Primi 20 anni tasso fisso annuo del 6.269%.
 Poi tasso variabile trimestrale così calcolato:
 $TV = (GBPLibor\ 3m + 2.35) \cdot act/360$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

| Data | Tasso annuo % | Val. cedola | Tipo cedola | Val. residuo | Val. ammortato | Giorni |
|------------|---------------|-------------|-------------|--------------|----------------|--------|
| 16/06/2019 | 6,269 | 6,269 | Certa | 350.000.000 | 0 | 365 |
| 16/06/2020 | 6,269 | 6,269 | Certa | 350.000.000 | 0 | 366 |
| 16/06/2021 | 6,269 | 6,269 | Certa | 350.000.000 | 0 | 365 |
| 16/06/2022 | 6,269 | 6,269 | Certa | 350.000.000 | 0 | 365 |
| 16/06/2023 | 6,269 | 6,269 | Certa | 350.000.000 | 0 | 365 |
| 16/06/2024 | 6,269 | 6,269 | Certa | 350.000.000 | 0 | 366 |
| 16/06/2025 | 6,269 | 6,269 | Certa | 350.000.000 | 0 | 365 |
| 16/06/2026 | 6,269 | 6,269 | Certa | 350.000.000 | 0 | 365 |
| 16/09/2026 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 0 | 92 |
| 16/12/2026 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 0 | 91 |
| 16/03/2027 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 0 | 90 |
| 16/06/2027 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 0 | 92 |
| 16/09/2027 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 0 | 92 |
| 16/12/2027 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 0 | 91 |
| 16/03/2028 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 0 | 91 |
| 16/06/2028 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 0 | 92 |
| 18/09/2028 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 0 | 94 |
| 18/12/2028 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 0 | 91 |
| 16/03/2029 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 0 | 88 |
| | | | | | | |
| 16/06/2050 | 0,000 | 0,825 | Prevista | 350.000.000 | 350.000.000 | 92 |

Annotazioni

Clausola di subordinazione: TIER I
 In caso di liquidazione dell'Emittente, il presente prestito sarà rimborsato solo dopo che siano stati soddisfatti tutti gli altri creditori non ugualmente subordinati.

Call

| Tipo | Dal | Al | Valore | Giorni preavviso |
|------|----------------|-----------------------|--------|------------------|
| Call | Dal 16/06/2026 | Ad ogni stacco cedola | 100 | 30 |

Indicizzazione cedole

| Da | A | Descrizione | Peso | Spread |
|------------|------------|-------------|-------|--------|
| 16/06/2026 | 16/06/2050 | GBPLIBOR3M | 1,000 | 2,350 |