

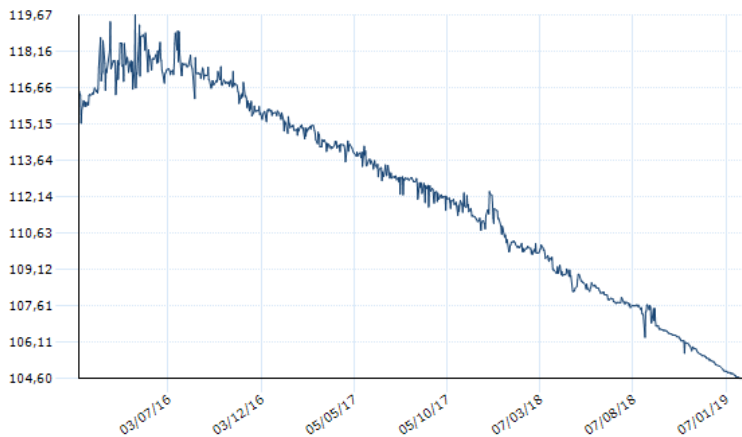
LAFARGE Protect 5.50% 12/19 / XS0473114543
Grado di rischio calcolato

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
104,45 EUR	Lafarge	16/12/2019	5,500%	0,147%	-1,220%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	104,45
Rendimento lordo	0,14702
Rendimento netto	-1,22045
Cedola in corso	5,50000
Rateo lordo	0,91918
Rateo netto	0,68019
Vita residua	0,83288
Duration modificata	0,83167
Convessità	1,52211
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Lafarge
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	750.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	16/12/2009
Prezzo emissione	99,0340
Decorrenza prima cedola regolare	16/12/2009
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	16/12/2019
Data estinzione	16/12/2019
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	104,4500	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	104,4600	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	104,4600	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	104,4600	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	104,5160	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	104,4500	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	104,6250	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
16/12/2019	5,500	5,500	Certa	750.000.000	750.000.000	365

Annotazioni

La presenza della clausola credit protection consente di incrementare le cedole fisse di un importo pari al 1.25%, sulla base del valore del rating dell'Emittente assegnato dalle agenzie Moody's ed S&P.