

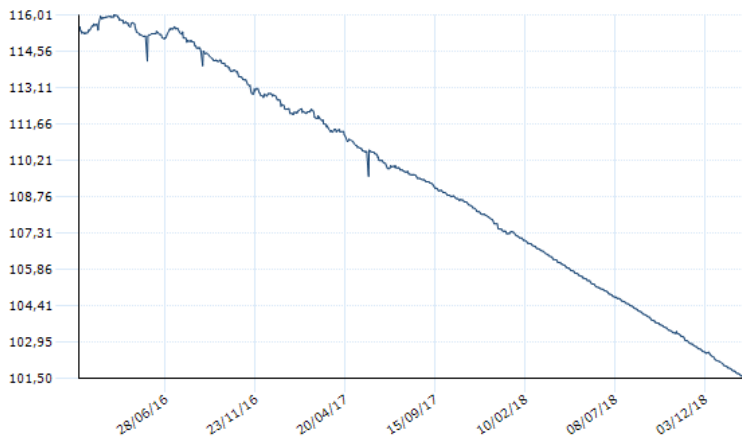
GAS NATURAL C.M. SA 5.375% 05/19 / XS0627188468
Grado di rischio calcolato

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
101,46 EUR	Gas Natural Capital Market	24/05/2019	5,375%	-0,055%	-1,397%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	101,459
Rendimento lordo	-0,05525
Rendimento netto	-1,39653
Cedola in corso	5,37500
Rateo lordo	3,93185
Rateo netto	2,90957
Vita residua	0,26849
Duration modificata	0,26845
Convessità	0,34053
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Gas Natural Capital Market
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	5.000.000,00
Nominale obbligazione	100.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	24/05/2011
Prezzo emissione	99,4100
Decorrenza prima cedola regolare	24/05/2011
Tasso annuale	5,3750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	24/05/2019
Data estinzione	24/05/2019
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	101,4590	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	101,4800	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	101,4600	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	97,1660	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	101,4600	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
24/05/2019	5,375	5,375	Certa	5.000.000,000	5.000.000,000	365