

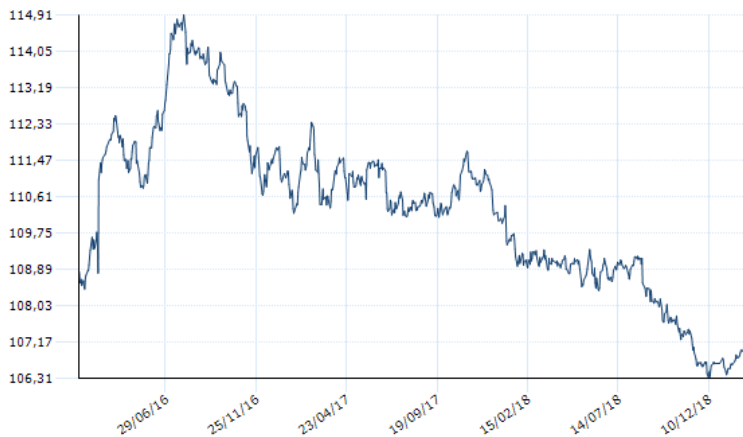
BMW FINANCE NV 2.375% 01/23 / XS0877622034
Grado di rischio calcolato

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
107,02 EUR	BMW Finance	24/01/2023	2,375%	0,568%	-0,045%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	107,02
Rendimento lordo	0,56758
Rendimento netto	-0,04498
Cedola in corso	2,37500
Rateo lordo	0,14315
Rateo netto	0,10593
Vita residua	3,94247
Duration modificata	3,78919
Convessità	18,41312
Cedola successiva	2,37500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	BMW Finance
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	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	24/01/2013
Prezzo emissione	99,1320
Decorrenza prima cedola regolare	24/01/2013
Tasso annuale	2,3750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	24/01/2023
Data estinzione	24/01/2023
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	105,9600	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	107,0200	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	107,0500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	107,0200	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	107,0800	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	107,2300	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	107,1600	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	107,0000	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
24/01/2020	2,375	2,375	Certa	750.000.000	0	365
24/01/2021	2,375	2,375	Certa	750.000.000	0	366
24/01/2022	2,375	2,375	Certa	750.000.000	0	365
24/01/2023	2,375	2,375	Certa	750.000.000	750.000.000	365