

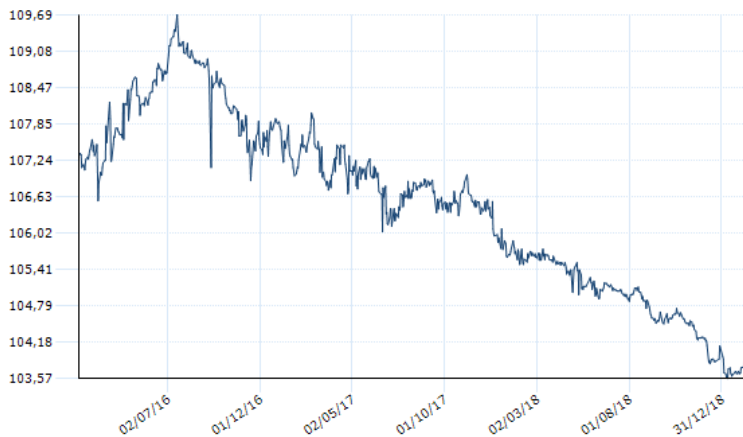
Grado di rischio calcolato

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
103,8 EUR	Basf SE	04/02/2021	1,875%	-0,052%	-0,556%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	103,8
Rendimento lordo	-0,05248
Rendimento netto	-0,55641
Cedola in corso	1,87500
Rateo lordo	0,05651
Rateo netto	0,04182
Vita residua	1,97260
Duration modificata	1,95248
Convessità	5,78638
Cedola successiva	1,87500
Mercato di riferimento	Börse Berlin

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Basf SE
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	04/02/2013
Prezzo emissione	99,0620
Decorrenza prima cedola regolare	04/02/2013
Tasso annuale	1,8750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	04/02/2021
Data estinzione	04/02/2021
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	108,9000	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	103,7900	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	103,7800	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	103,7800	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	103,8000	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	99,9000	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	103,8810	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	103,7900	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
04/02/2020	1,875	1,875	Certa	1.000.000.000	0	365
04/02/2021	1,875	1,875	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	366

Annotazioni

Callable fino al 03/02/2021 con 'make-whole' premium legato al Comparable Benchmark Yield + 15 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	04/02/2013	03/02/2021	100	30