

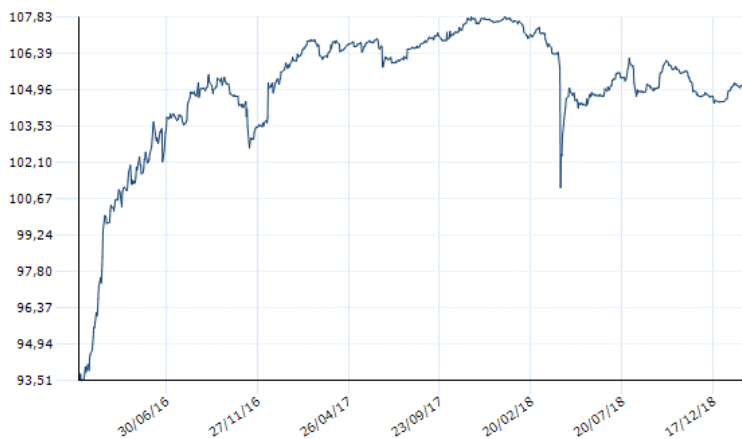
GAZ CAPITAL 3.60% 02/21 / XS1038646078
Grado di rischio calcolato

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
105,18 EUR	Gaz Capital	26/02/2021	3,600%	1,008%	0,108%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	105,18
Rendimento lordo	1,00776
Rendimento netto	0,10810
Cedola in corso	3,60000
Rateo lordo	3,49151
Rateo netto	2,58372
Vita residua	2,03288
Duration modificata	1,91438
Convessità	5,71300
Cedola successiva	3,60000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Gaz Capital
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	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	26/02/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	26/02/2014
Tasso annuale	3,6000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	26/02/2021
Data estinzione	26/02/2021
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	105,1800	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	105,3500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	105,3600	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	105,3600	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	105,3600	EUR
Euro TLX	13/02/2019	105,3800	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
26/02/2019	3,600	3,600	Certa	750.000.000	0	365
26/02/2020	3,600	3,600	Certa	750.000.000	0	365
26/02/2021	3,600	3,600	Certa	750.000.000	750.000.000	366