

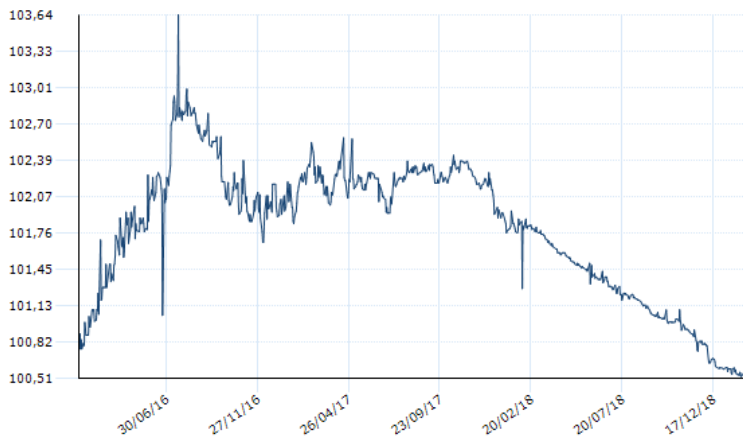
**DEUTSCHE LUFTHANSA 1.125% 09/19 / XS1109110251**
**Grado di rischio calcolato**

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

**Grado Liquidità**

Molto liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
100,52 EUR	Deutsche Lufthansa	12/09/2019	1,125%	0,212%	-0,097%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,52
Rendimento lordo	0,21178
Rendimento netto	-0,09661
Cedola in corso	1,12500
Rateo lordo	0,48082
Rateo netto	0,35581
Vita residua	0,57260
Duration modificata	0,57140
Convessità	0,89669
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

**Dati anagrafici principali**

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

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	12/09/2014
Prezzo emissione	99,5560
Decorrenza prima cedola regolare	12/09/2014
Tasso annuale	1,1250
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	12/09/2019
Data estinzione	12/09/2019
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	101,9600	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	100,5200	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,5200	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,5100	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	100,5100	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	100,6080	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	100,5600	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,5200	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,7650	EUR

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
12/09/2019	1,125	1,125	Certa	500.000.000	500.000.000	365