

BRF SA Green 2.75% 06/22 / XS1242327168

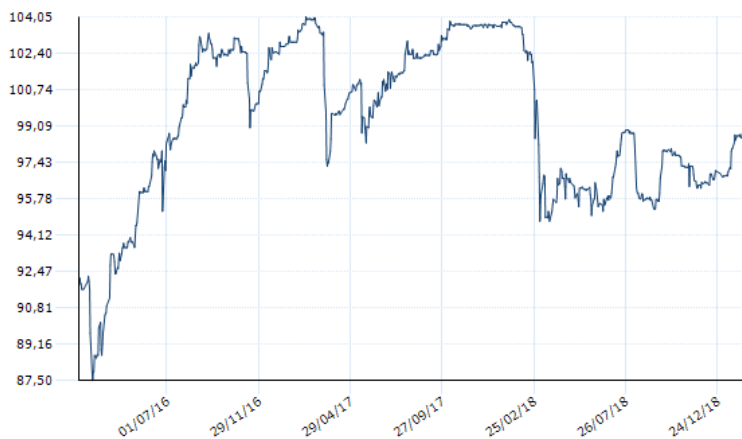
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Poco liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
99,25 EUR	BRF	03/06/2022	2,750%	2,987%	2,255%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,25
Rendimento lordo	2,98703
Rendimento netto	2,25529
Cedola in corso	2,75000
Rateo lordo	1,93630
Rateo netto	1,43286
Vita residua	3,29863
Duration modificata	3,04894
Convessità	12,58447
Cedola successiva	2,75000
Mercato di riferimento	Börse Berlin

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	03/06/2015
Prezzo emissione	99,5480
Decorrenza prima cedola regolare	03/06/2015
Tasso annuale	2,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	03/06/2022
Data estinzione	03/06/2022
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	99,1500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	99,2500	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	99,2500	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	99,7200	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	99,2900	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
03/06/2019	2,750	2,750	Certa	500.000.000	0	365
03/06/2020	2,750	2,750	Certa	500.000.000	0	366
03/06/2021	2,750	2,750	Certa	500.000.000	0	365
03/06/2022	2,750	2,750	Certa	500.000.000	500.000.000	365

Annotazioni

Callable fino al 02/06/2022 con 'make-whole' premium legato al BUND Rate + 40 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	03/06/2015	02/06/2022	100	30