

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

Altamente illiquido

Ente emittente CommerzBank	Scadenza 06/10/2025	Cedola in corso 0,162%	Rendimento lordo 0,000%	Rendimento netto 0,000%
-------------------------------	------------------------	---------------------------	----------------------------	----------------------------

Dati anagrafici principali

Ente emittente	CommerzBank
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	10.000.000
Nominale obbligazione	100.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	06/08/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	06/10/2015
Data Prorata	06/08/2015
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Analisi

Data ultima quotazione	14/02/2019
Data valutazione	14/02/2019
Data valuta	18/02/2019
Prezzo	0
Rendimento lordo	0,00000
Rendimento netto	0,00000
Cedola in corso	0,16200
Rateo lordo	0,07478
Rateo netto	0,05534
Vita residua	6,63562
Duration modificata	0,00000
Convessità	0,00000
Cedola successiva	0,16500

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	06/10/2025
Data estinzione	06/10/2025
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Formula di indicizzazione
 $TV = (\text{Euribor } 3m + 0,95) * \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg)}$
Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
08/04/2019	0,000	0,162	Certa	10.000.000	0	91
08/07/2019	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	91
07/10/2019	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	91
06/01/2020	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	91
06/04/2020	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	91
06/07/2020	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	91
06/10/2020	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	92
06/01/2021	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	92
06/04/2021	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	90
06/07/2021	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	91
06/10/2021	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	92
06/01/2022	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	92
06/04/2022	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	90
06/07/2022	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	91
06/10/2022	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	92
06/01/2023	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	92
06/04/2023	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	90
06/07/2023	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	91
06/10/2023	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	0	92
.....						
06/10/2025	0,000	0,165	Prevista	10.000.000	10.000.000	91

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
06/08/2015	06/10/2025	EURIBOR3M	1,000	0,950