

VOLKSWAGEN SERV. NV 2.25% 04/25 / XS1596735701
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Liquido

12/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
95,99 GBP	Volkswagen Financial Service	12/04/2025	2,250%	2,966%	2,363%


Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	95,99
Rendimento lordo	2,96630
Rendimento netto	2,36276
Cedola in corso	2,25000
Rateo lordo	1,89863
Rateo netto	1,40499
Vita residua	6,16164
Duration modificata	5,54371
Convessità	37,82444
Cedola successiva	2,25000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Volkswagen Financial Service
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	GBP
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	350.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	12/04/2017
Prezzo emissione	99,8210
Decorrenza prima cedola regolare	12/04/2017
Tasso annuale	2,2500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	12/04/2025
Data estinzione	12/04/2025
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	12/02/2019	95,9900	GBP
Börse Düsseldorf	12/02/2019	96,0400	GBP
Bayerische Börse	12/02/2019	96,0200	GBP
Börse Berlin	12/02/2019	96,0400	GBP
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	96,4580	GBP
Börse Stuttgart	12/02/2019	96,1300	GBP

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
12/04/2019	2,250	2,250	Certa	350.000.000	0	365
12/04/2020	2,250	2,250	Certa	350.000.000	0	366
12/04/2021	2,250	2,250	Certa	350.000.000	0	365
12/04/2022	2,250	2,250	Certa	350.000.000	0	365
12/04/2023	2,250	2,250	Certa	350.000.000	0	365
12/04/2024	2,250	2,250	Certa	350.000.000	0	366
12/04/2025	2,250	2,250	Certa	350.000.000	350.000.000	365