

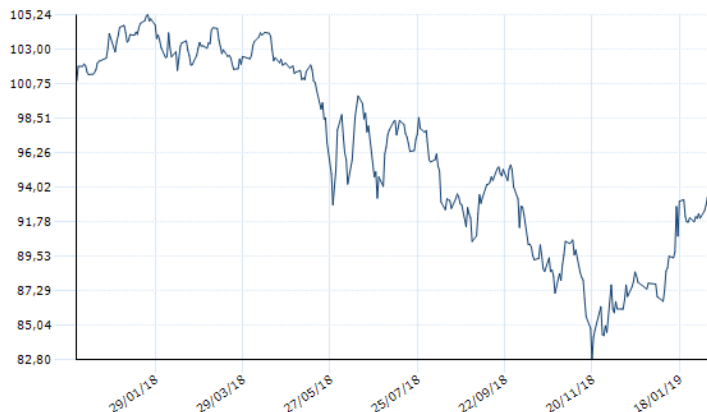
Grado di rischio calcolato

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
93,28 EUR	Cattolica Assicurazioni	14/12/2047	4,250%	4,646%	3,486%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	93,28
Rendimento lordo	4,64558
Rendimento netto	3,48562
Cedola in corso	4,25000
Rateo lordo	0,72956
Rateo netto	0,53988
Vita residua	28,84658
Duration modificata	13,60731
Convessità	198,76626
Cedola successiva	4,25000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Cattolica Assicurazioni
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Börse Berlin	12/02/2019	90,6700	EUR
Euro TLX	13/02/2019	93,2800	EUR

Caratteristiche principali

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	100.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	14/12/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	14/12/2017
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	SI

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	14/12/2047
Data estinzione	14/12/2047
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Formula di indicizzazione

Primi 10 anni tasso fisso annuo del 4,25%. Poi:
 TV= (Euribor3m + 4,455) (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
16/12/2019	4,250	4,250	Certa	500.000.000	0	91
14/12/2020	4,250	4,250	Certa	500.000.000	0	91
14/12/2021	4,250	4,250	Certa	500.000.000	0	91
14/12/2022	4,250	4,250	Certa	500.000.000	0	91
14/12/2023	4,250	4,250	Certa	500.000.000	0	91
16/12/2024	4,250	4,250	Certa	500.000.000	0	91
15/12/2025	4,250	4,250	Certa	500.000.000	0	91
14/12/2026	4,250	4,250	Certa	500.000.000	0	91
14/12/2027	4,250	4,250	Certa	500.000.000	0	91
14/03/2028	0,000	1,032	Prevista	500.000.000	0	91
14/06/2028	0,000	1,032	Prevista	500.000.000	0	92
14/09/2028	0,000	1,032	Prevista	500.000.000	0	92
14/12/2028	0,000	1,032	Prevista	500.000.000	0	91
14/03/2029	0,000	1,032	Prevista	500.000.000	0	90
14/06/2029	0,000	1,032	Prevista	500.000.000	0	92
14/09/2029	0,000	1,032	Prevista	500.000.000	0	92
14/12/2029	0,000	1,032	Prevista	500.000.000	0	91
14/03/2030	0,000	1,032	Prevista	500.000.000	0	90
14/06/2030	0,000	1,032	Prevista	500.000.000	0	92
.....						
14/12/2047	0,000	1,032	Prevista	500.000.000	500.000.000	91

Annotazioni

Obbligazione subordinata : Lower Tier II
 Clausola di subordinazione: in caso di liquidazione dell'emittente, il presente prestito sarà rimborsato solo dopo che siano stati soddisfatti gli altri creditori non ugualmente subordinati.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call	Dal 14/12/2027	Ad ogni stacco cedola	100	30

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
14/12/2027	14/12/2047	EURIBOR3M	1,000	4,455