

INTESA/S.PAOLO TF+Eurib3m 07/20 / IT0005025512

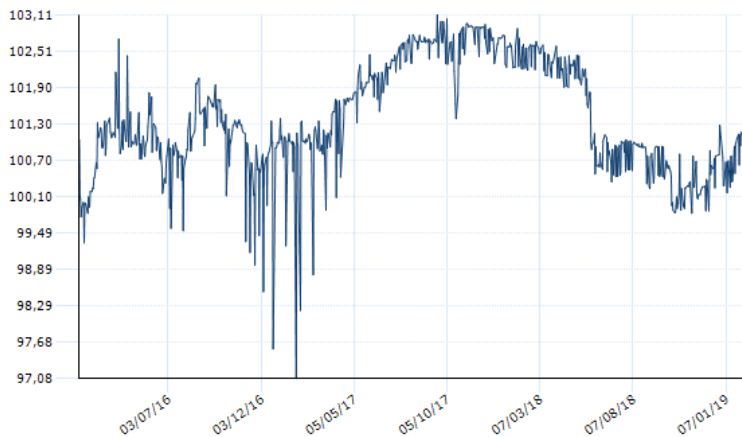
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Liquido

| | | | | | |
|------------|-----------------|------------|-----------------|------------------|------------------|
| 13/02/2019 | Ente emittente | Scadenza | Cedola in corso | Rendimento lordo | Rendimento netto |
| 101,18 EUR | Intesa SanPaolo | 10/07/2020 | 1,250% | 0,400% | 0,079% |


Analisi

| | |
|------------------------|------------|
| Data ultima quotazione | 13/02/2019 |
| Data valutazione | 13/02/2019 |
| Data valuta | 15/02/2019 |
| Prezzo | 101,18 |
| Rendimento lordo | 0,40022 |
| Rendimento netto | 0,07947 |
| Cedola in corso | 1,25000 |
| Rateo lordo | 0,75342 |
| Rateo netto | 0,55753 |
| Vita residua | 1,40000 |
| Duration modificata | 0,42216 |
| Convessità | 0,60037 |
| Cedola successiva | 1,25000 |
| Mercato di riferimento | Euro TLX |

Dati anagrafici principali

| | |
|-------------------|-------------------------|
| Ente emittente | Intesa SanPaolo |
| Tipo obbligazione | Interest Rate Linked |
| Tipo tasso | Tasso Fisso + Variabile |
| Divisa | EUR |
| Convertibilità | Nessuno |

Caratteristiche principali

| | |
|----------------------------------|------------|
| Nominale circolante | 37.590.000 |
| Nominale obbligazione | 10.000,00 |
| Taglio minimo | 10.000,00 |
| Corso | Secco |
| Sottoscrizione | Regolar |
| Data emissione | 10/07/2014 |
| Prezzo emissione | 100,0000 |
| Decorrenza prima cedola regolare | 10/07/2014 |
| Frequenza cedola | 1 |
| Base rateo cedola | ACT/ACT |
| Cedola minima % | 1,25 |
| Cedola massima % | 3,50 |
| Subordinato | NO |

Rimborso

| | |
|-----------------------------|-----------------|
| Tipo ammortamento | Unica Soluzione |
| Data 1° rimborso | 10/07/2020 |
| Data estinzione | 10/07/2020 |
| 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 |
|-----------------|------------|----------|--------|
| Börse Stuttgart | 13/02/2019 | 100,3600 | EUR |
| Euro TLX | 13/02/2019 | 101,1800 | EUR |

Formula di indicizzazione

Primo anno tasso fisso annuo del 3.00%.
Poi cedola variabile annuale così calcolata:
TV= (Euribor 3m + 0.25) (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

| Data flusso | Tasso annuo % | Val. cedola | Tipo cedola | Val. residuo | Val. ammortato | Giorni |
|-------------|---------------|-------------|-------------|--------------|----------------|--------|
| 10/07/2019 | 1,250 | 1,250 | Certa | 37.590.000 | 0 | 365 |
| 10/07/2020 | 0,000 | 1,250 | Prevista | 37.590.000 | 37.590.000 | 366 |

Indicizzazione cedole

| Da | A | Descrizione indice | Peso | Spread |
|------------|------------|--------------------|-------|--------|
| 10/07/2015 | 10/07/2020 | EURIBOR3M | 1,000 | 0,250 |