

**CITIGROUP INC 3.30% 04/25 / US172967JP75**
**Grado di rischio calcolato**

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

**Grado Liquidità**

Poco liquido

12/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
98,19 USD	CitiGroup	27/04/2025	1,650%	3,660%	2,775%


**Analisi**

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	98,189
Rendimento lordo	3,65956
Rendimento netto	2,77525
Cedola in corso	1,65000
Rateo lordo	0,98083
Rateo netto	0,72582
Vita residua	6,20274
Duration modificata	5,40316
Convessità	36,45557
Cedola successiva	1,65000
Mercato di riferimento	Börse Berlin

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	CitiGroup
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	1.500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	27/04/2015
Prezzo emissione	99,8140
Decorrenza prima cedola regolare	27/04/2015
Tasso annuale	3,3000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	27/04/2025
Data estinzione	27/04/2025
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	98,4800	USD
Börse Düsseldorf	12/02/2019	98,3600	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	98,1890	USD
Börse Berlin	12/02/2019	98,1890	USD
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	98,5150	USD

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
27/04/2019	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	182
27/10/2019	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	183
27/04/2020	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	183
27/10/2020	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	183
27/04/2021	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	182
27/10/2021	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	183
27/04/2022	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	182
27/10/2022	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	183
27/04/2023	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	182
27/10/2023	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	183
27/04/2024	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	183
27/10/2024	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	0	183
27/04/2025	3,300	1,650	Certa	1.500.000.000	1.500.000.000	182