

TELECOM ITALIA CAP. 6.00% 09/34 / US87927VAM00
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
85,42 USD	Telecom Italia Capital SA	30/09/2034	3,000%	7,750%	5,961%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	85,42
Rendimento lordo	7,74986
Rendimento netto	5,96083
Cedola in corso	3,00000
Rateo lordo	2,25000
Rateo netto	1,66500
Vita residua	15,63288
Duration modificata	8,93608
Convessità	116,32417
Cedola successiva	3,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Telecom Italia Capital SA
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	30/09/2005
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	30/09/2005
Tasso annuale	6,0000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	30/09/2034
Data estinzione	30/09/2034
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	86,9600	USD
Frankfurter Börse	13/02/2019	85,4200	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	85,5400	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	85,5200	USD
Börse Berlin	13/02/2019	85,5100	USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	86,0390	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	85,5200	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
30/03/2019	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	181
30/09/2019	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	184
30/03/2020	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	182
30/09/2020	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	184
30/03/2021	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	181
30/09/2021	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	184
30/03/2022	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	181
30/09/2022	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	184
30/03/2023	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	181
30/09/2023	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	184
30/03/2024	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	182
30/09/2024	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	184
30/03/2025	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	181
30/09/2025	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	184
30/03/2026	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	181
30/09/2026	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	184
30/03/2027	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	181
30/09/2027	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	184
30/03/2028	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	0	182
.....						
30/09/2034	6,000	3,000	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	184

Annotazioni

Callable fino al 29/09/2034 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 30 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	30/09/2005	29/09/2034	100	30