

JPMTR ZC 0% 01/27 / XS0071996515

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
87,76 ITL	Morgan Guaranty Trust Company..	21/01/2027	0,000%	1,659%	0,223%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	87,76
Rendimento lordo	1,65862
Rendimento netto	0,22272
Cedola in corso	N/A
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	7,93699
Duration modificata	7,80749
Convessità	68,63701
Cedola successiva	N/A
Mercato di riferimento	Euro TLX

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	Morgan Guaranty Trust Company of New York
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Zero Coupon
Divisa	ITL
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	1.750.000.000,00
Nominale obbligazione	5.000.000,00
Taglio minimo	5.000.000,00
Corso	Prezzo Tel-quel
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	21/01/1997
Prezzo emissione	12,8500
Decorrenza prima cedola regolare	21/01/1997
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	21/01/2027
Data estinzione	21/01/2027
Base rateo capitale	Composta
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
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	89,9550	ITL
Euro TLX	13/02/2019	87,7600	ITL

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
21/01/2027	0,000	0,000	Certa	1.750.000.000,000	1.750.000.000,000	10.957