

ATLANTIA SPA 5.875% 06/24 / XS0193945655

Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Poco liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
117,6 EUR	Atlantia	09/06/2024	5,875%	2,309%	0,933%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	117,603
Rendimento lordo	2,30911
Rendimento netto	0,93287
Cedola in corso	5,87500
Rateo lordo	4,04007
Rateo netto	2,98965
Vita residua	5,31781
Duration modificata	4,51701
Convessità	26,82715
Cedola successiva	5,87500
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Atlantia
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	100.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	09/06/2004
Prezzo emissione	99,9650
Decorrenza prima cedola regolare	09/06/2004
Tasso annuale	5,8750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	09/06/2024
Data estinzione	09/06/2024
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
ExtraMOT	13/02/2019	117,4500	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	117,6030	EUR
Euro TLX	13/02/2019	117,8700	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	117,7500	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
09/06/2019	5,875	5,875	Certa	1.000.000.000	0	365
09/06/2020	5,875	5,875	Certa	1.000.000.000	0	366
09/06/2021	5,875	5,875	Certa	1.000.000.000	0	365
09/06/2022	5,875	5,875	Certa	1.000.000.000	0	365
09/06/2023	5,875	5,875	Certa	1.000.000.000	0	365
09/06/2024	5,875	5,875	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	366