

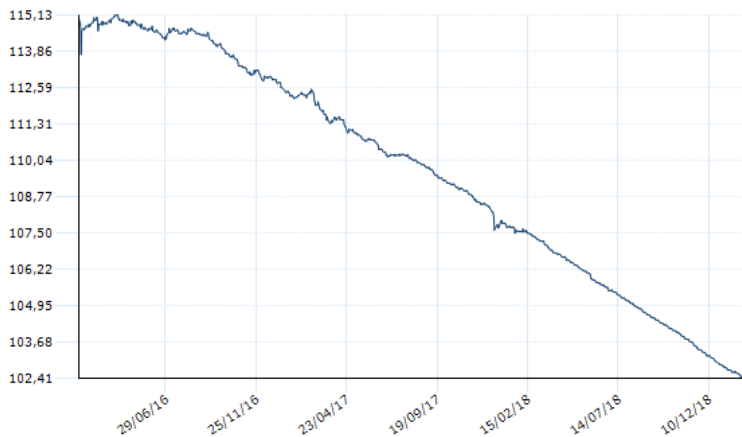
CITIGROUP INC 5.00% 08/19 / XS0197646218
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Molto liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
102,37 EUR	CitiGroup	02/08/2019	5,000%	-0,136%	-1,375%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	102,368
Rendimento lordo	-0,13589
Rendimento netto	-1,37536
Cedola in corso	5,00000
Rateo lordo	2,69863
Rateo netto	1,99699
Vita residua	0,46027
Duration modificata	0,45998
Convessità	0,67170
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	02/08/2004
Prezzo emissione	99,4930
Decorrenza prima cedola regolare	02/08/2004
Tasso annuale	5,0000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	02/08/2019
Data estinzione	02/08/2019
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	103,9000	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	102,3680	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	102,3500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	102,3700	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	102,3500	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	102,3880	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	102,3760	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	102,3700	EUR
Euro TLX	13/02/2019	102,3800	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	102,3250	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
02/08/2019	5,000	5,000	Certa	2.500.000.000	2.500.000.000	365