

ENEL FINANCE INT.SA 5.625% 08/24 / XS0452188054
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
115,06 GBP	ENEL Finance International	14/08/2024	5,625%	2,637%	1,285%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	115,06
Rendimento lordo	2,63736
Rendimento netto	1,28490
Cedola in corso	5,62500
Rateo lordo	2,85103
Rateo netto	2,10976
Vita residua	5,49863
Duration modificata	4,69186
Convessità	28,54699
Cedola successiva	5,62500
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	ENEL Finance International
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	GBP
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	850.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	17/09/2009
Prezzo emissione	98,8000
Decorrenza prima cedola regolare	14/08/2010
Data Prorata	17/09/2009
Tasso annuale	5,6250
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	14/08/2024
Data estinzione	14/08/2024
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	114,5200	GBP
Bayerische Börse	13/02/2019	114,3440	GBP
ExtraMOT	13/02/2019	115,1200	GBP
Börse Stuttgart	13/02/2019	114,5600	GBP
Euro TLX	13/02/2019	115,0600	GBP
Hi-MTF	13/02/2019	114,6600	GBP

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
14/08/2019	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
14/08/2020	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	366
14/08/2021	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
14/08/2022	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
14/08/2023	5,625	5,625	Certa	850.000.000	0	365
14/08/2024	5,625	5,625	Certa	850.000.000	850.000.000	366