

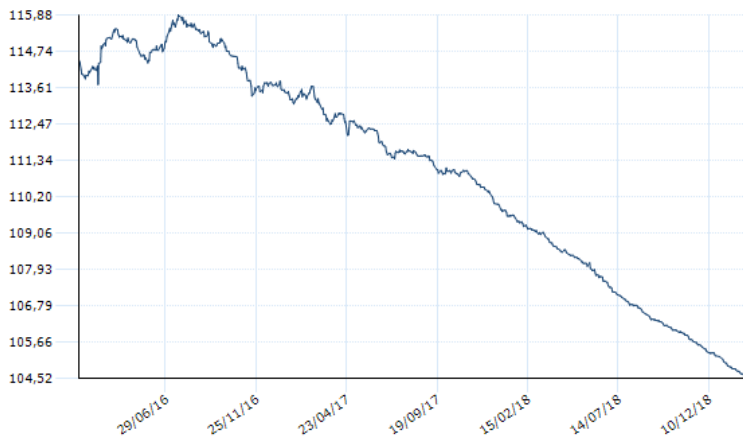
Grado di rischio calcolato

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
104,55 EUR	ACEA	16/03/2020	4,500%	0,272%	-0,851%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	104,55
Rendimento lordo	0,27179
Rendimento netto	-0,85067
Cedola in corso	4,50000
Rateo lordo	4,14247
Rateo netto	3,06542
Vita residua	1,08219
Duration modificata	1,03809
Convessità	2,15216
Cedola successiva	4,50000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	16/03/2010
Prezzo emissione	99,7790
Decorrenza prima cedola regolare	16/03/2010
Tasso annuale	4,5000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	16/03/2020
Data estinzione	16/03/2020
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	104,5500	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	104,5600	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	104,6730	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	104,6620	EUR
Euro TLX	13/02/2019	104,7700	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	104,6150	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
16/03/2019	4,500	4,500	Certa	500.000.000	0	365
16/03/2020	4,500	4,500	Certa	500.000.000	500.000.000	366