

ITALCEMENTI Protect 5.375% 03/20 / XS0496716282
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
105,2 EUR	Italcementi Finance	19/03/2020	6,625%	1,748%	0,096%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	105,2
Rendimento lordo	1,74793
Rendimento netto	0,09635
Cedola in corso	6,62500
Rateo lordo	6,04418
Rateo netto	4,47269
Vita residua	1,09041
Duration modificata	1,01308
Convessità	2,07632
Cedola successiva	6,62500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	750.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	19/03/2010
Prezzo emissione	99,2230
Decorrenza prima cedola regolare	19/03/2010
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	19/03/2020
Data estinzione	19/03/2020
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	105,2000	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	105,0000	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	105,2300	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	105,1720	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	105,1180	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	105,4530	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	105,2000	EUR
Euro TLX	13/02/2019	105,3700	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	105,3000	EUR

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
19/03/2019	6,625	6,625	Certa	750.000.000	0	365
19/03/2020	6,625	6,625	Certa	750.000.000	750.000.000	366

Annotazioni

La presenza della clausola credit protection consente di incrementare le cedole fisse di un importo pari al 1.25%, sulla base del valore del rating dell'Emittente assegnato dalle agenzie Moody's ed S&P. La cedola e' stata incrementata dell'1.25 il 19/03/2012.