

INTESA/S.PAOLO 561a 4.125% 04/20 / XS0500187843

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
104,46 EUR	Intesa SanPaolo	14/04/2020	4,125%	0,263%	-0,785%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	104,461
Rendimento lordo	0,26343
Rendimento netto	-0,78522
Cedola in corso	4,12500
Rateo lordo	3,46952
Rateo netto	2,56745
Vita residua	1,16164
Duration modificata	1,12049
Convessità	2,40959
Cedola successiva	4,12500
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.158.950.000
Nominale obbligazione	50.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	14/04/2010
Prezzo emissione	99,1260
Decorrenza prima cedola regolare	14/04/2010
Tasso annuale	4,1250
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	14/04/2020
Data estinzione	14/04/2020
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
ExtraMOT	13/02/2019	104,4790	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	104,4610	EUR
Euro TLX	13/02/2019	104,5300	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	104,5050	EUR

Formula di indicizzazione

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
14/04/2019	4,125	4,125	Certa	1.158.950.000	0	365
14/04/2020	4,125	4,125	Certa	1.158.950.000	1.158.950.000	366