

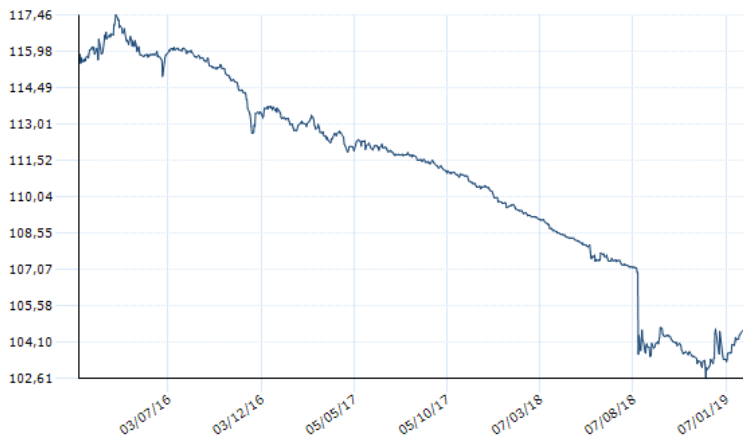
ATLANTIA 4.375% 03/20 / XS0828749761
Grado di rischio calcolato

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
104,4 EUR	Atlantia	16/03/2020	4,375%	0,286%	-0,821%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	104,4
Rendimento lordo	0,28551
Rendimento netto	-0,82109
Cedola in corso	4,37500
Rateo lordo	4,02740
Rateo netto	2,98027
Vita residua	1,08219
Duration modificata	1,03900
Convessità	2,15383
Cedola successiva	4,37500
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Atlantia
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	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	14/09/2012
Prezzo emissione	99,4410
Decorrenza prima cedola regolare	16/03/2013
Data Prorata	14/09/2012
Tasso annuale	4,3750
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
ExtraMOT	13/02/2019	104,4500	EUR
Euro TLX	13/02/2019	104,4000	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	104,7550	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
16/03/2019	4,375	4,375	Certa	750.000.000	0	365
16/03/2020	4,375	4,375	Certa	750.000.000	750.000.000	366