

**INTESA/S.PAOLO 4.375% 10/19 / XS0842828120**
**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
102,9 EUR	Intesa SanPaolo	15/10/2019	4,375%	0,001%	-1,097%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	102,9
Rendimento lordo	0,00097
Rendimento netto	-1,09745
Cedola in corso	4,37500
Rateo lordo	1,47432
Rateo netto	1,09099
Vita residua	0,66301
Duration modificata	0,66301
Convessità	1,10258
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

**Dati anagrafici principali**

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

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	1.250.000,000
Nominale obbligazione	100.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/10/2012
Prezzo emissione	99,4810
Decorrenza prima cedola regolare	15/10/2012
Tasso annuale	4,3750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/10/2019
Data estinzione	15/10/2019
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	102,9020	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	102,8480	EUR
Euro TLX	13/02/2019	102,9000	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	102,8250	EUR

**Formula di indicizzazione**
**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/10/2019	4,375	4,375	Certa	1.250.000,000	1.250.000,000	365