

A2A SPA 4.50% 11/19 / XS0859920406

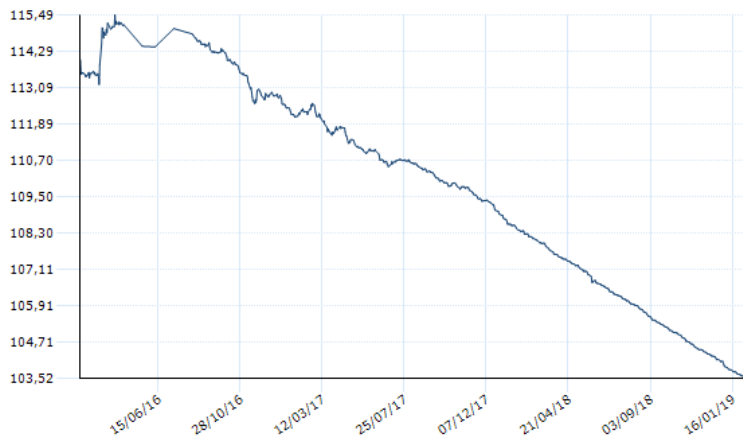
Grado di rischio calcolato

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
103,49 EUR	A2A	28/11/2019	4,500%	0,049%	-1,068%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	103,485
Rendimento lordo	0,04944
Rendimento netto	-1,06841
Cedola in corso	4,50000
Rateo lordo	0,97397
Rateo netto	0,72074
Vita residua	0,78356
Duration modificata	0,78318
Convessità	1,39616
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

Ente emittente	A2A
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	Regular
Data emissione	28/11/2012
Prezzo emissione	99,7180
Decorrenza prima cedola regolare	28/11/2012
Tasso annuale	4,5000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	28/11/2019
Data estinzione	28/11/2019
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	103,8040	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	103,4850	EUR
Euro TLX	13/02/2019	103,5700	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	103,7450	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
28/11/2019	4,500	4,500	Certa	750.000.000	750.000.000	365