

A2A SPA 4.375% 01/21 / XS0951567030

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
107,9 EUR	A2A	10/01/2021	4,375%	0,205%	-0,887%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	107,904
Rendimento lordo	0,20482
Rendimento netto	-0,88747
Cedola in corso	4,37500
Rateo lordo	0,43151
Rateo netto	0,31932
Vita residua	1,90411
Duration modificata	1,86250
Convessità	5,36657
Cedola successiva	4,37500
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	500.000,000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	10/07/2013
Prezzo emissione	99,3230
Decorrenza prima cedola regolare	10/01/2014
Data Prorata	10/07/2013
Tasso annuale	4,3750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	10/01/2021
Data estinzione	10/01/2021
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	108,1590	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	107,9040	EUR
Euro TLX	13/02/2019	107,9800	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	108,1300	EUR

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
10/01/2020	4,375	4,375	Certa	500.000.000	0	365
10/01/2021	4,375	4,375	Certa	500.000.000	500.000.000	366