

FFSS 4.00% 07/20 / XS0954248729

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
104,56 EUR	Ferrovie dello Stato	22/07/2020	4,000%	0,777%	-0,253%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	104,56
Rendimento lordo	0,77715
Rendimento netto	-0,25270
Cedola in corso	4,00000
Rateo lordo	2,27945
Rateo netto	1,68679
Vita residua	1,43288
Duration modificata	1,38470
Convessità	3,32697
Cedola successiva	4,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Ferrovie dello Stato
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	22/07/2013
Prezzo emissione	99,0690
Decorrenza prima cedola regolare	22/07/2013
Tasso annuale	4,0000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	22/07/2020
Data estinzione	22/07/2020
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	104,8470	EUR
Euro TLX	13/02/2019	104,5600	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	104,7700	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
22/07/2019	4,000	4,000	Certa	750.000.000	0	365
22/07/2020	4,000	4,000	Certa	750.000.000	750.000.000	366