

INTESA/S.PAULO 4.00% 10/23 / XS0986194883

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
109,38 EUR	Intesa SanPaolo	30/10/2023	4,000%	1,894%	0,893%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	109,382
Rendimento lordo	1,89351
Rendimento netto	0,89287
Cedola in corso	4,00000
Rateo lordo	1,18356
Rateo netto	0,87584
Vita residua	4,70685
Duration modificata	4,27564
Convessità	23,37785
Cedola successiva	4,00000
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	30/10/2013
Prezzo emissione	99,1610
Decorrenza prima cedola regolare	30/10/2013
Tasso annuale	4,0000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	30/10/2023
Data estinzione	30/10/2023
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	109,5200	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	109,3820	EUR
Euro TLX	13/02/2019	109,5100	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	109,4900	EUR

Formula di indicizzazione

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
30/10/2019	4,000	4,000	Certa	1.000.000.000	0	365
30/10/2020	4,000	4,000	Certa	1.000.000.000	0	366
30/10/2021	4,000	4,000	Certa	1.000.000.000	0	365
30/10/2022	4,000	4,000	Certa	1.000.000.000	0	365
30/10/2023	4,000	4,000	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	365