

FFSS 3.50% 12/21 / XS1004118904

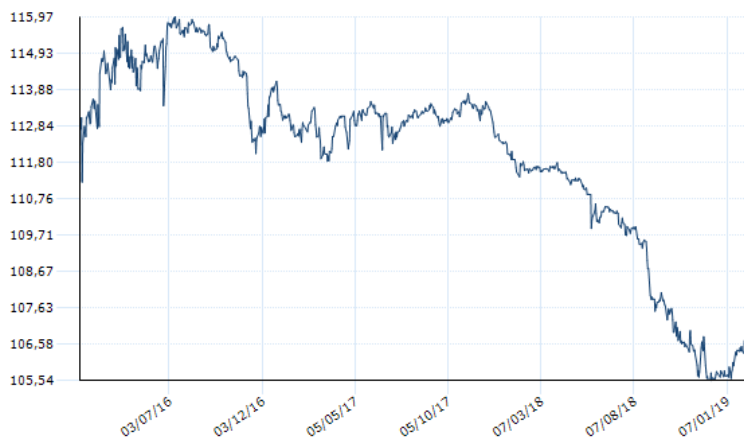
Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Grado Liquidità

Poco liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
106,31 EUR	Ferrovie dello Stato	13/12/2021	3,500%	1,212%	0,326%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	106,31
Rendimento lordo	1,21176
Rendimento netto	0,32569
Cedola in corso	3,50000
Rateo lordo	0,61370
Rateo netto	0,45414
Vita residua	2,82740
Duration modificata	2,69786
Convessità	10,09287
Cedola successiva	3,50000
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	600.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	13/12/2013
Prezzo emissione	99,5000
Decorrenza prima cedola regolare	13/12/2013
Tasso annuale	3,5000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	13/12/2021
Data estinzione	13/12/2021
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	105,5400	EUR
Euro TLX	13/02/2019	106,3100	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	106,5100	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
13/12/2019	3,500	3,500	Certa	600.000.000	0	365
13/12/2020	3,500	3,500	Certa	600.000.000	0	366
13/12/2021	3,500	3,500	Certa	600.000.000	600.000.000	365