

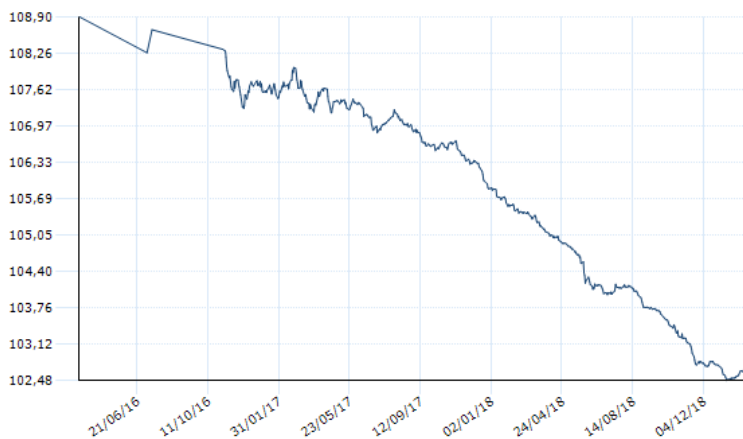
ASS. GENERALI 2.875% 01/20 / XS1014759648
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Molto liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
102,6 EUR	Assicurazioni Generali	14/01/2020	2,875%	0,020%	-0,714%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	102,604
Rendimento lordo	0,01992
Rendimento netto	-0,71439
Cedola in corso	2,87500
Rateo lordo	0,25205
Rateo netto	0,18652
Vita residua	0,91233
Duration modificata	0,91215
Convessità	1,74398
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Assicurazioni Generali
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.250.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	14/01/2014
Prezzo emissione	99,6040
Decorrenza prima cedola regolare	14/01/2014
Tasso annuale	2,8750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	14/01/2020
Data estinzione	14/01/2020
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	102,6130	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	102,6040	EUR
Euro TLX	13/02/2019	102,6500	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	102,6100	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
14/01/2020	2,875	2,875	Certa	1.250.000.000	1.250.000.000	365