

INTESA/S.PAOLO 3.50% 01/22 / XS1018032950
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
106,43 EUR	Intesa SanPaolo	17/01/2022	3,500%	1,243%	0,363%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	106,43
Rendimento lordo	1,24270
Rendimento netto	0,36303
Cedola in corso	3,50000
Rateo lordo	0,27808
Rateo netto	0,20578
Vita residua	2,92329
Duration modificata	2,79171
Convessità	10,69989
Cedola successiva	3,50000
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	750.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	17/01/2014
Prezzo emissione	99,7120
Decorrenza prima cedola regolare	17/01/2014
Tasso annuale	3,5000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	17/01/2022
Data estinzione	17/01/2022
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	106,4700	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	106,4300	EUR
Euro TLX	13/02/2019	106,4400	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	106,4250	EUR

Formula di indicizzazione
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
17/01/2020	3,500	3,500	Certa	750.000.000	0	365
17/01/2021	3,500	3,500	Certa	750.000.000	0	366
17/01/2022	3,500	3,500	Certa	750.000.000	750.000.000	365