

INTESA/S.PAOLO 1.125% 01/20 / XS1168003900
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
100,89 EUR	Intesa SanPaolo	14/01/2020	1,125%	0,142%	-0,172%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,894
Rendimento lordo	0,14170
Rendimento netto	-0,17233
Cedola in corso	1,12500
Rateo lordo	0,09863
Rateo netto	0,07299
Vita residua	0,91233
Duration modificata	0,91105
Convessità	1,73977
Cedola successiva	0,00000
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	1.500.000,000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	14/01/2015
Prezzo emissione	99,4460
Decorrenza prima cedola regolare	14/01/2015
Tasso annuale	1,1250
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	100,9430	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	100,8940	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,9000	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,8750	EUR

Formula di indicizzazione
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
14/01/2020	1,125	1,125	Certa	1.500.000,000	1.500.000,000	365