

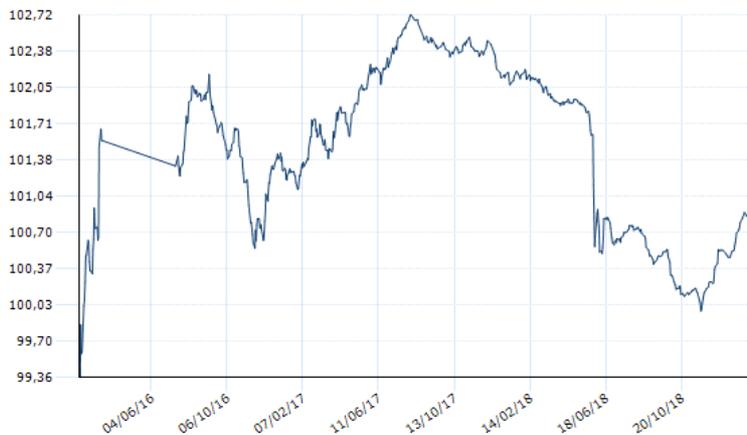
**INTESA/S.PAOLO 1.125% 01/20 / XS1168003900**
**Grado di rischio calcolato**

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