

INTESA/S.PAOLO 1.125% 03/22 / XS1197351577
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
99,5 EUR	Intesa SanPaolo	04/03/2022	1,125%	1,292%	0,986%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,5
Rendimento lordo	1,29214
Rendimento netto	0,98620
Cedola in corso	1,12500
Rateo lordo	1,07260
Rateo netto	0,79373
Vita residua	3,04932
Duration modificata	2,94473
Convessità	11,72616
Cedola successiva	1,12500
Mercato di riferimento	Euro TLX

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	04/03/2015
Prezzo emissione	99,6390
Decorrenza prima cedola regolare	04/03/2015
Tasso annuale	1,1250
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	04/03/2022
Data estinzione	04/03/2022
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	99,5500	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	99,4570	EUR
Euro TLX	13/02/2019	99,5000	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	99,5100	EUR

Formula di indicizzazione
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
04/03/2019	1,125	1,125	Certa	1.500.000.000	0	365
04/03/2020	1,125	1,125	Certa	1.500.000.000	0	366
04/03/2021	1,125	1,125	Certa	1.500.000.000	0	365
04/03/2022	1,125	1,125	Certa	1.500.000.000	1.500.000.000	365