

INTESA/S.PAULO Eur3m 06/20 / XS1246144650

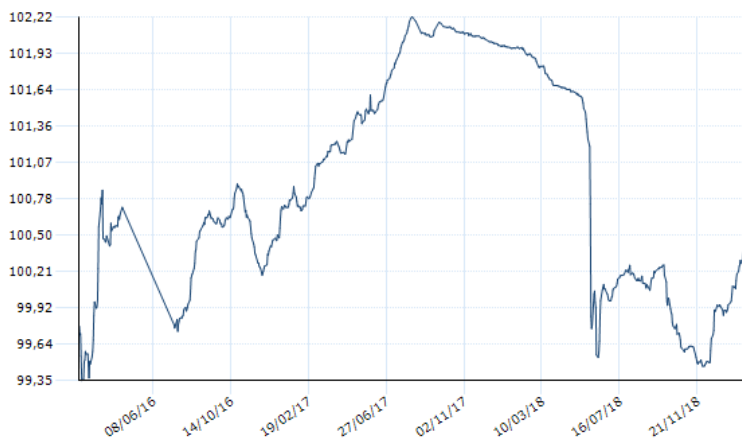
Grado di rischio calcolato

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
100,46 EUR	Intesa SanPaolo	15/06/2020	0,181%	0,405%	0,203%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,457
Rendimento lordo	0,40541
Rendimento netto	0,20311
Cedola in corso	0,18060
Rateo lordo	0,12316
Rateo netto	0,09114
Vita residua	1,33151
Duration modificata	0,09879
Convessità	0,10855
Cedola successiva	0,18800
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Intesa SanPaolo
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/06/2015
Prezzo emissione	99,8520
Decorrenza prima cedola regolare	15/06/2015
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/06/2020
Data estinzione	15/06/2020
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	100,5420	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	100,4570	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,4400	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,4750	EUR

Formula di indicizzazione
 $TV = (\text{Euribor } 3m + 1.05) * \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2\text{gg)}$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/03/2019	0,739	0,181	Certa	1.000.000.000	0	88
17/06/2019	0,000	0,188	Prevista	1.000.000.000	0	94
16/09/2019	0,000	0,188	Prevista	1.000.000.000	0	91
16/12/2019	0,000	0,188	Prevista	1.000.000.000	0	91
16/03/2020	0,000	0,188	Prevista	1.000.000.000	0	91
15/06/2020	0,000	0,188	Prevista	1.000.000.000	1.000.000.000	91

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/06/2015	15/06/2020	EURIBOR3M	1,000	1,050