

IREN SPA 2.75% 11/22 / XS1314238459

Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Grado Liquidità

Poco liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
107,01 EUR	Iren	02/11/2022	2,750%	0,824%	0,119%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	107,01
Rendimento lordo	0,82360
Rendimento netto	0,11900
Cedola in corso	2,75000
Rateo lordo	0,79110
Rateo netto	0,58541
Vita residua	3,71507
Duration modificata	3,53469
Convessità	16,32498
Cedola successiva	2,75000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Iren
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	02/11/2015
Prezzo emissione	99,3980
Decorrenza prima cedola regolare	02/11/2015
Tasso annuale	2,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	02/11/2022
Data estinzione	02/11/2022
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	107,2900	EUR
Euro TLX	13/02/2019	107,0100	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	106,7950	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
02/11/2019	2,750	2,750	Certa	500.000.000	0	365
02/11/2020	2,750	2,750	Certa	500.000.000	0	366
02/11/2021	2,750	2,750	Certa	500.000.000	0	365
02/11/2022	2,750	2,750	Certa	500.000.000	500.000.000	365