

CITIGROUP GLOBAL TF+TV 09/26 / XS1389110716
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
95,27 USD	Citigroup Global Markets Holdings	30/09/2026	2,500%	4,266%	3,329%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	95,27
Rendimento lordo	4,26639
Rendimento netto	3,32871
Cedola in corso	2,50000
Rateo lordo	0,93750
Rateo netto	0,69375
Vita residua	7,62740
Duration modificata	1,78384
Convessità	4,96592
Cedola successiva	2,50000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Citigroup Global Markets Holdings
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Euro TLX	13/02/2019	95,2700	USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	750.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	30/09/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	30/09/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30E/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	30/09/2026
Data estinzione	30/09/2026
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Formula di indicizzazione

Primi 4 anni tasso fisso annuo del 2.50%.
 Poi tasso variabile annuo così calcolati:
 $TV = (\text{USDLibor } 3m + 1.12) \text{ (puntuale 2gg)}$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
30/09/2019	2,500	2,500	Certa	750.000.000	0	365
30/09/2020	2,500	2,500	Certa	750.000.000	0	366
30/09/2021	0,000	3,856	Prevista	750.000.000	0	365
30/09/2022	0,000	3,856	Prevista	750.000.000	0	365
30/09/2023	0,000	3,856	Prevista	750.000.000	0	365
30/09/2024	0,000	3,856	Prevista	750.000.000	0	366
30/09/2025	0,000	3,856	Prevista	750.000.000	0	365
30/09/2026	0,000	3,856	Prevista	750.000.000	750.000.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
30/09/2020	30/09/2026	USDLIBOR3M	1,000	1,120