

AUTOSTRADIE ITALIA 1.75% 02/27 / XS1528093799
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
92,52 EUR	Autostrade per l'Italia	01/02/2027	1,750%	2,809%	2,312%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	92,52
Rendimento lordo	2,80948
Rendimento netto	2,31156
Cedola in corso	1,75000
Rateo lordo	0,06712
Rateo netto	0,04967
Vita residua	7,96712
Duration modificata	7,27465
Convessità	62,11867
Cedola successiva	1,75000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Autostrade per l'Italia
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	600.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	01/12/2016
Prezzo emissione	99,0500
Decorrenza prima cedola regolare	01/02/2018
Data Prorata	01/12/2016
Tasso annuale	1,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/02/2027
Data estinzione	01/02/2027
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	92,3600	EUR
Euro TLX	13/02/2019	92,5200	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/02/2020	1,750	1,750	Certa	600.000.000	0	365
01/02/2021	1,750	1,750	Certa	600.000.000	0	366
01/02/2022	1,750	1,750	Certa	600.000.000	0	365
01/02/2023	1,750	1,750	Certa	600.000.000	0	365
01/02/2024	1,750	1,750	Certa	600.000.000	0	365
01/02/2025	1,750	1,750	Certa	600.000.000	0	366
01/02/2026	1,750	1,750	Certa	600.000.000	0	365
01/02/2027	1,750	1,750	Certa	600.000.000	600.000.000	365