

INTESA/S.PAOLO 1.375% 01/24 / XS1551306951

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
97,51 EUR	Intesa SanPaolo	18/01/2024	1,375%	1,908%	1,521%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,51
Rendimento lordo	1,90840
Rendimento netto	1,52133
Cedola in corso	1,37500
Rateo lordo	0,10548
Rateo netto	0,07805
Vita residua	4,92603
Duration modificata	4,70052
Convessità	27,08417
Cedola successiva	1,37500
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	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	18/01/2017
Prezzo emissione	99,3130
Decorrenza prima cedola regolare	18/01/2017
Tasso annuale	1,3750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	18/01/2024
Data estinzione	18/01/2024
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	97,4500	EUR
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	97,2870	EUR
Euro TLX	13/02/2019	97,5100	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	97,5300	EUR

**Formula di indicizzazione**
**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/01/2020	1,375	1,375	Certa	1.000.000.000	0	365
18/01/2021	1,375	1,375	Certa	1.000.000.000	0	366
18/01/2022	1,375	1,375	Certa	1.000.000.000	0	365
18/01/2023	1,375	1,375	Certa	1.000.000.000	0	365
18/01/2024	1,375	1,375	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	365