

ITALGAS SPA 1.125% 03/24 / XS1578294081

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
100,27 EUR	Italgas	14/03/2024	1,125%	1,069%	0,767%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,27
Rendimento lordo	1,06878
Rendimento netto	0,76656
Cedola in corso	1,12500
Rateo lordo	1,04178
Rateo netto	0,77092
Vita residua	5,07945
Duration modificata	4,86329
Convessità	29,02923
Cedola successiva	1,12500
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	650.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	14/03/2017
Prezzo emissione	99,7060
Decorrenza prima cedola regolare	14/03/2017
Tasso annuale	1,1250
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	14/03/2024
Data estinzione	14/03/2024
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	97,8400	EUR
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	100,1630	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,2700	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,1800	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
14/03/2019	1,125	1,125	Certa	650.000.000	0	365
14/03/2020	1,125	1,125	Certa	650.000.000	0	366
14/03/2021	1,125	1,125	Certa	650.000.000	0	365
14/03/2022	1,125	1,125	Certa	650.000.000	0	365
14/03/2023	1,125	1,125	Certa	650.000.000	0	365
14/03/2024	1,125	1,125	Certa	650.000.000	650.000.000	366