

INTESA/S.PAOLO Eur3m 04/22 / XS1599167589
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
97,93 EUR	Intesa SanPaolo	19/04/2022	0,164%	1,335%	1,151%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,93
Rendimento lordo	1,33463
Rendimento netto	1,15148
Cedola in corso	0,16410
Rateo lordo	0,04458
Rateo netto	0,03299
Vita residua	3,17534
Duration modificata	0,17698
Convessità	0,20831
Cedola successiva	0,16500
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Intesa SanPaolo
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	19/04/2017
Prezzo emissione	99,8500
Decorrenza prima cedola regolare	19/04/2017
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	19/04/2022
Data estinzione	19/04/2022
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	97,5300	EUR
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	97,6460	EUR
Euro TLX	13/02/2019	97,9300	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	98,0350	EUR

Formula di indicizzazione
 $TV = (\text{Euribor } 3m + 0,95) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2gg)$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
23/04/2019	0,642	0,164	Certa	1.500.000.000	0	92
19/07/2019	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	0	87
21/10/2019	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	0	94
20/01/2020	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	0	91
20/04/2020	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	0	91
20/07/2020	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	0	91
19/10/2020	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	0	91
19/01/2021	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	0	92
19/04/2021	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	0	90
19/07/2021	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	0	91
19/10/2021	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	0	92
19/01/2022	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	0	92
19/04/2022	0,000	0,165	Prevista	1.500.000.000	1.500.000.000	90

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
19/04/2017	19/04/2022	EURIBOR3M	1,000	0,950