

FFSS 1.50% 06/25 / XS1639488771

## 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
97,85 EUR	Ferrovie dello Stato	27/06/2025	1,500%	1,859%	1,465%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,85
Rendimento lordo	1,85930
Rendimento netto	1,46483
Cedola in corso	1,50000
Rateo lordo	0,95753
Rateo netto	0,70858
Vita residua	6,36712
Duration modificata	5,94919
Convessità	42,43843
Cedola successiva	1,50000
Mercato di riferimento	Euro TLX

## Dati anagrafici principali

Ente emittente	Ferrovie dello Stato
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

## Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	100.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	28/06/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	27/06/2018
Data Prorata	28/06/2017
Tasso annuale	1,5000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	27/06/2025
Data estinzione	27/06/2025
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	97,8700	EUR
Euro TLX	13/02/2019	97,8500	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	97,5600	EUR

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
27/06/2019	1,500	1,500	Certa	1.000.000.000	0	365
27/06/2020	1,500	1,500	Certa	1.000.000.000	0	366
27/06/2021	1,500	1,500	Certa	1.000.000.000	0	365
27/06/2022	1,500	1,500	Certa	1.000.000.000	0	365
27/06/2023	1,500	1,500	Certa	1.000.000.000	0	365
27/06/2024	1,500	1,500	Certa	1.000.000.000	0	366
27/06/2025	1,500	1,500	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	365