

ICCREA BANCA 1.50% 10/22 / XS1696459731

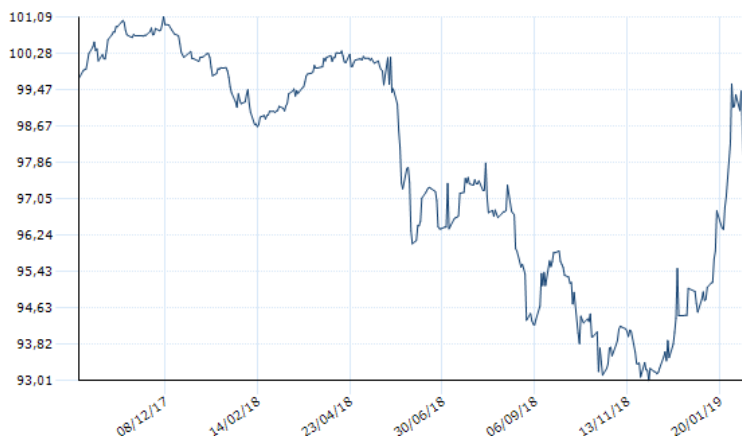
Grado di rischio calcolato

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
98,39 EUR	ICCREA	11/10/2022	1,500%	1,959%	1,565%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,39
Rendimento lordo	1,95865
Rendimento netto	1,56526
Cedola in corso	1,50000
Rateo lordo	0,52192
Rateo netto	0,38622
Vita residua	3,65479
Duration modificata	3,49759
Convessità	15,85606
Cedola successiva	1,50000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	ICCREA
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	Regular
Data emissione	11/10/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	11/10/2017
Tasso annuale	1,5000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	11/10/2022
Data estinzione	11/10/2022
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
Börse Berlin	12/02/2019	97,5700	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	98,4500	EUR
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	98,4650	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	97,6900	EUR
Euro TLX	13/02/2019	98,3900	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	98,3550	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
11/10/2019	1,500	1,500	Certa	600.000.000	0	365
11/10/2020	1,500	1,500	Certa	600.000.000	0	366
11/10/2021	1,500	1,500	Certa	600.000.000	0	365
11/10/2022	1,500	1,500	Certa	600.000.000	600.000.000	365