

**MEDIOBANCA 62a USDLibor3m 04/22 / IT0005090045**
**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
93,22 USD	MedioBanca	13/04/2022	0,699%	5,175%	4,408%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	93,22
Rendimento lordo	5,17499
Rendimento netto	4,40757
Cedola in corso	0,69920
Rateo lordo	0,24862
Rateo netto	0,18398
Vita residua	3,15890
Duration modificata	0,00220
Convessità	0,00221
Cedola successiva	0,68400
Mercato di riferimento	Euro TLX

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	MedioBanca
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

**Mercati di quotazione**

Mercato	Data	Valore	Valuta
Euro TLX	13/02/2019	93,2200	USD

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	91.340.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	13/04/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	13/04/2015
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30/360
Cedola minima %	0,50
Cedola massima %	0,95
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	13/04/2022
Data estinzione	13/04/2022
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

**Formula di indicizzazione**
 $TV = (\text{USDLibor } 3m) / 4 \text{ (puntuale 2gg)}$ 
**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
13/04/2019	0,000	0,699	Certa	91.340.000	0	90
13/07/2019	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	0	91
13/10/2019	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	0	92
13/01/2020	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	0	92
13/04/2020	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	0	91
13/07/2020	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	0	91
13/10/2020	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	0	92
13/01/2021	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	0	92
13/04/2021	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	0	90
13/07/2021	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	0	91
13/10/2021	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	0	92
13/01/2022	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	0	92
13/04/2022	0,000	0,684	Prevista	91.340.000	91.340.000	90

**Indicizzazione cedole**

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
13/04/2015	13/04/2022	USDLIBOR3M	1,000	0,000