

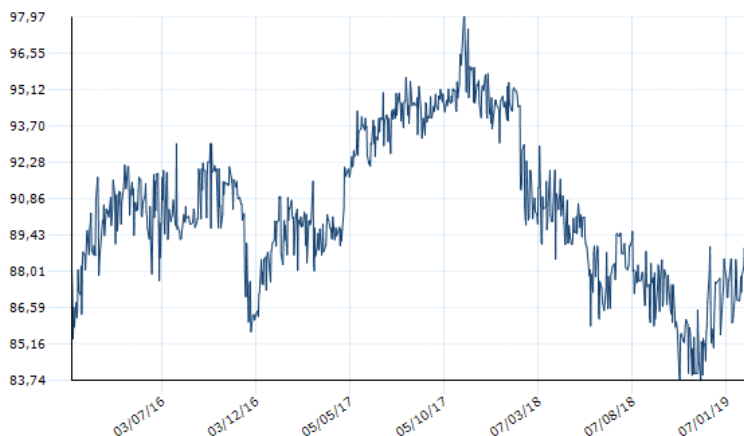
MEDIOBANCA 63a DJEURO 04/22 / IT0005090102
Grado di rischio calcolato

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
88,36 USD	MedioBanca	19/04/2022	0,000%	3,974%	3,974%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	88,36
Rendimento lordo	3,97418
Rendimento netto	3,97418
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	3,17534
Duration modificata	0,06660
Convessità	0,07104
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	MedioBanca
Tipo obbligazione	Index Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore Valuta
Euro TLX	13/02/2019	88,3600 USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	42.908.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco + Tel-quel
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	17/04/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	17/04/2015
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
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%

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
17/04/2019	0,000	0,000	Prevista	42.908.000	0	365
21/04/2020	0,000	0,000	Prevista	42.908.000	0	370
19/04/2021	0,000	0,000	Prevista	42.908.000	0	363
19/04/2022	0,000	0,000	Prevista	42.908.000	42.908.000	365

Annotazioni

Primi 3 anni tasso fisso annuo del 2.70%.
 Annualmente (20 maggio) verra' corrisposta una cedola pari a:
 Cedola= VN * 6.00% se a > 105% * b
 0.00% se Altrimenti
 Dove:
 a,b : DJEUROSTOXX 50
 a : Valore di chiusura dell'Indice rilevato annualmente il 10 aprile dal 2019 al 2022 (se non festivi)
 b : Valore di chiusura dell'Indice al 17 aprile 2015