

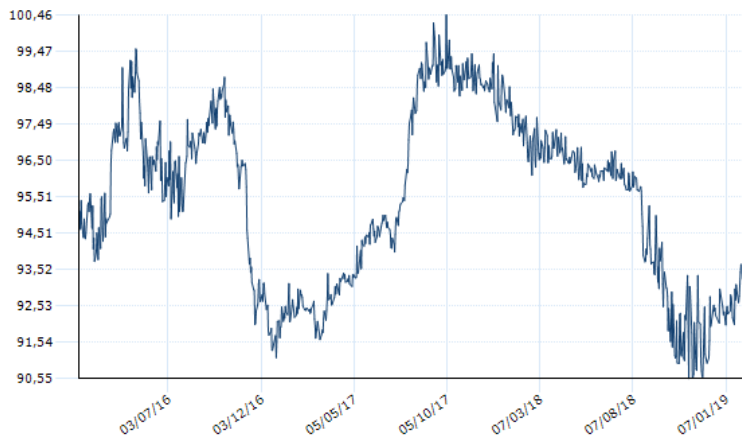
MEDIOBANCA 66a St-up 05/22 / IT0005104572
Grado di rischio calcolato

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
93,63 USD	MedioBanca	15/05/2022	2,300%	4,728%	4,032%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	93,63
Rendimento lordo	4,72779
Rendimento netto	4,03158
Cedola in corso	2,30000
Rateo lordo	1,72500
Rateo netto	1,27650
Vita residua	3,24658
Duration modificata	2,96535
Convessità	11,91151
Cedola successiva	2,40000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	MedioBanca
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Euro TLX	13/02/2019	93,6300	USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	98.782.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/05/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	15/05/2015
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/05/2022
Data estinzione	15/05/2022
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
15/05/2019	2,300	2,300	Certa	98.782.000	0	365
15/05/2020	2,400	2,400	Certa	98.782.000	0	366
15/05/2021	2,600	2,600	Certa	98.782.000	0	365
15/05/2022	2,800	2,800	Certa	98.782.000	98.782.000	365