

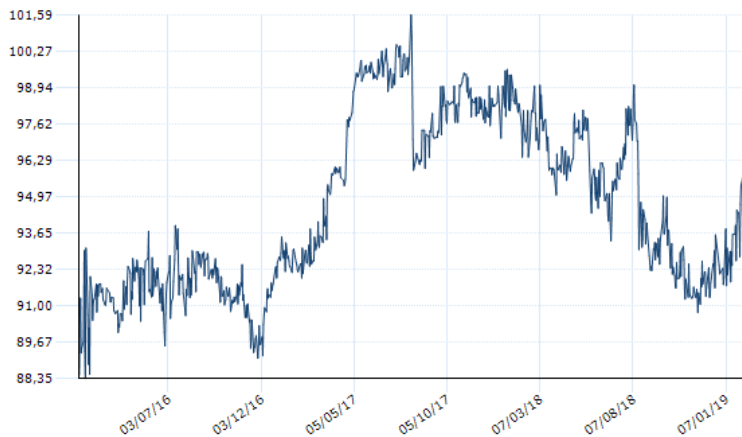
MEDIOBANCA 68a DJEURO 08/20 / IT0005120149
Grado di rischio calcolato

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
93,28 USD	MedioBanca	17/08/2020	0,000%	4,734%	4,734%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	93,28
Rendimento lordo	4,73358
Rendimento netto	4,73358
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	1,50411
Duration modificata	0,43613
Convessità	0,62634
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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	46.200.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco + Tel-quel
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	17/08/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	17/08/2015
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	17/08/2020
Data estinzione	17/08/2020
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
Euro TLX	13/02/2019	93,2800	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
17/08/2019	0,000	0,000	Prevista	46.200.000	0	365
17/08/2020	0,000	0,000	Prevista	46.200.000	46.200.000	366

Annotazioni

Primo anno tasso fisso annuo del 2.50%.
 Annualmente (17 agosto) verrà corrisposta una cedola pari a:
 $Cedola = VN * 4.50\%$ se $a > 100\% * b$
 0.00% se Altrimenti
 Dove:
 a,b : DJEUROSTOXX 50
 a : Valore di chiusura dell'Indice rilevato annualmente il 10 agosto dal 2017 al 2020 (se non festivi)
 b : Valore di chiusura dell'Indice al 17 agosto 2015