

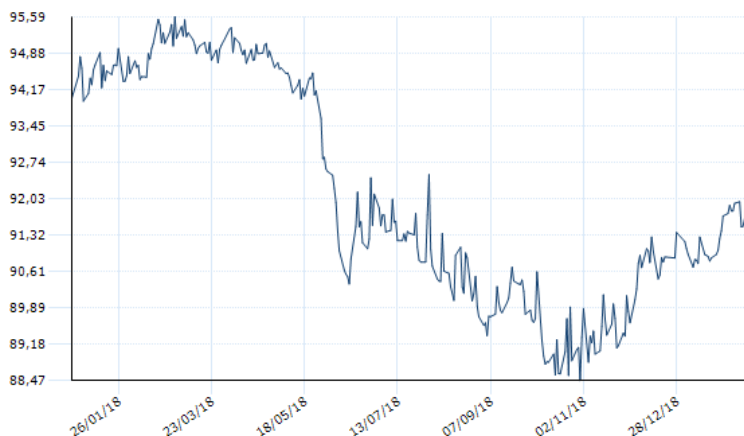
MEDIOBANCA USD 72a TF+TV 10/22 / IT0005126120
Grado di rischio calcolato

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
91,59 USD	MedioBanca	30/10/2022	0,688%	5,364%	4,586%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	91,59
Rendimento lordo	5,36362
Rendimento netto	4,58560
Cedola in corso	0,68760
Rateo lordo	0,12225
Rateo netto	0,09046
Vita residua	3,70685
Duration modificata	0,01297
Convessità	0,01314
Cedola successiva	0,68800
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Euro TLX	13/02/2019	91,5900	USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	257.006.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	30/10/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	30/10/2015
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola minima %	0,50
Cedola massima %	0,88
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	30/10/2022
Data estinzione	30/10/2022
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Formula di indicizzazione

Primo anno tasso fisso trimestrale dello 0.50%.
Poi cedole variabili trimestrali così' calcolate:
TV= (USDLibor 3m)/4 (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
30/04/2019	2,751	0,688	Certa	257.006.000	0	90
30/07/2019	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	91
30/10/2019	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	92
30/01/2020	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	92
30/04/2020	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	91
30/07/2020	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	91
30/10/2020	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	92
30/01/2021	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	92
30/04/2021	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	90
30/07/2021	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	91
30/10/2021	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	92
30/01/2022	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	92
30/04/2022	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	90
30/07/2022	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	0	91
30/10/2022	0,000	0,688	Prevista	257.006.000	257.006.000	92

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
30/10/2016	30/10/2022	USDLIBOR3M	1,000	0,000