

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
93,64 USD	Unicredit Group	16/05/2022	0,700%	5,025%	4,243%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	93,64
Rendimento lordo	5,02504
Rendimento netto	4,24323
Cedola in corso	0,70000
Rateo lordo	0,69239
Rateo netto	0,51237
Vita residua	3,24932
Duration modificata	2,94106
Convessità	11,75819
Cedola successiva	0,70000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Euro TLX	13/02/2019	93,6400	USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	350.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	16/05/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	16/05/2016
Tasso annuale	2,8000
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	16/05/2022
Data estinzione	16/05/2022
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
16/02/2019	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	92
16/05/2019	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	89
16/08/2019	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	92
16/11/2019	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	92
16/02/2020	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	92
16/05/2020	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	90
16/08/2020	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	92
16/11/2020	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	92
16/02/2021	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	92
16/05/2021	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	89
16/08/2021	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	92
16/11/2021	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	92
16/02/2022	2,800	0,700	Certa	350.000.000	0	92
16/05/2022	2,800	0,700	Certa	350.000.000	350.000.000	89