

UNICREDIT 01a TF+USDLib3m 05/23 / IT0005253098
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
93,76 USD	Unicredit Group	23/05/2023	1,000%	5,246%	4,267%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	93,76
Rendimento lordo	5,24587
Rendimento netto	4,26663
Cedola in corso	1,00000
Rateo lordo	0,91111
Rateo netto	0,67422
Vita residua	4,26849
Duration modificata	0,14634
Convessità	0,16776
Cedola successiva	1,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	10.512.500
Nominale obbligazione	12.500,00
Taglio minimo	12.500,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	23/05/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	23/05/2017
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	23/05/2023
Data estinzione	23/05/2023
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	93,7600	USD

Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso trimestrale dell'1.00%. Poi:
 $TV = (\text{USDLibor } 3m(360) + 0.73)/4$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
23/02/2019	4,000	1,000	Certa	10.512.500	0	92
23/05/2019	4,000	1,000	Certa	10.512.500	0	89
23/08/2019	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/11/2019	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/02/2020	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/05/2020	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	90
23/08/2020	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/11/2020	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/02/2021	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/05/2021	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	89
23/08/2021	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/11/2021	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/02/2022	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/05/2022	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	89
23/08/2022	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/11/2022	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/02/2023	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	0	92
23/05/2023	0,000	0,867	Prevista	10.512.500	10.512.500	89

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
23/05/2019	23/05/2023	USDLIBOR3M	1,000	0,730