

MACQUARIE BANK sub. 6.00% 09/20 / XS0543111768
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
108,51 EUR	Macquarie Bank	21/09/2020	6,000%	0,625%	-0,833%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	108,51
Rendimento lordo	0,62478
Rendimento netto	-0,83306
Cedola in corso	6,00000
Rateo lordo	2,41644
Rateo netto	1,78816
Vita residua	1,60000
Duration modificata	1,53666
Convessità	3,93852
Cedola successiva	6,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Macquarie Bank
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	600.000,00
Nominale obbligazione	50.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	21/09/2010
Prezzo emissione	99,7430
Decorrenza prima cedola regolare	21/09/2010
Tasso annuale	6,0000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	SI

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	21/09/2020
Data estinzione	21/09/2020
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	108,5100	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	108,5400	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	108,5300	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	108,5400	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	108,5300	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
21/09/2019	6,000	6,000	Certa	600.000,000	0	365
21/09/2020	6,000	6,000	Certa	600.000,000	600.000,000	366

Annotazioni

Clausola di subordinazione.
In caso di liquidazione della Banca Emittente, le obbligazioni saranno rimborsate solo dopo che siano stati soddisfatti tutti gli altri creditori non ugualmente subordinati.