

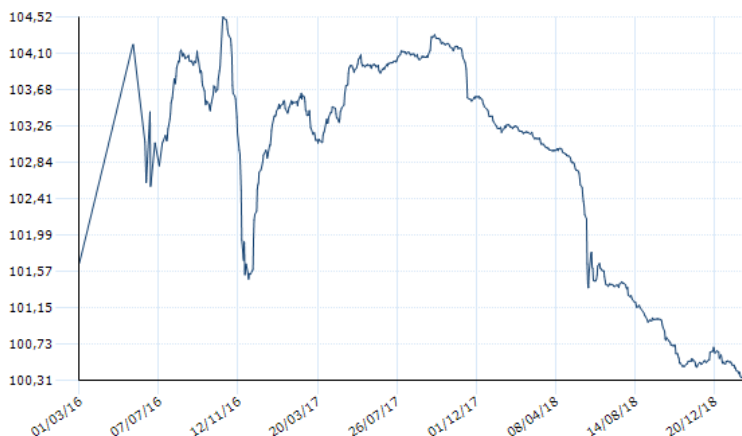
**BANCO BPM 3.50% 03/19 / XS1044894944**
**Grado di rischio calcolato**

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

**Grado Liquidità**

Poco liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
100,25 EUR	Banco BPM	14/03/2019	3,500%	0,153%	-0,739%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,247
Rendimento lordo	0,15332
Rendimento netto	-0,73862
Cedola in corso	3,50000
Rateo lordo	3,24110
Rateo netto	2,39841
Vita residua	0,07397
Duration modificata	0,07386
Convessità	0,07920
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	Banco BPM
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	1.250.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	14/03/2014
Prezzo emissione	99,6350
Decorrenza prima cedola regolare	14/03/2014
Tasso annuale	3,5000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	14/03/2019
Data estinzione	14/03/2019
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
ExtraMOT	13/02/2019	100,2720	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	100,2470	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,2500	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,2500	EUR

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
14/03/2019	3,500	3,500	Certa	1.250.000.000	1.250.000.000	365