

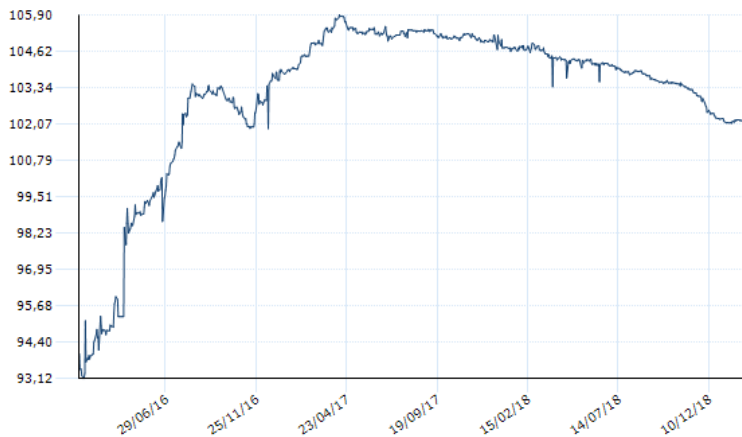
**JEFFERIES GROUP 2.375% 05/20 / XS1069522057**
**Grado di rischio calcolato**

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
102,28 EUR	Jefferies Group	20/05/2020	2,375%	0,548%	-0,065%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	102,28
Rendimento lordo	0,54848
Rendimento netto	-0,06506
Cedola in corso	2,37500
Rateo lordo	1,76336
Rateo netto	1,30488
Vita residua	1,26027
Duration modificata	1,23067
Convessità	2,76065
Cedola successiva	2,37500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	Jefferies Group
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	20/05/2014
Prezzo emissione	99,7460
Decorrenza prima cedola regolare	20/05/2014
Tasso annuale	2,3750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	20/05/2020
Data estinzione	20/05/2020
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	102,2800	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	102,2200	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	102,2800	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	102,2800	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	98,3420	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	102,2900	EUR

**Formula di indicizzazione**
**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
20/05/2019	2,375	2,375	Certa	500.000.000	0	365
20/05/2020	2,375	2,375	Certa	500.000.000	500.000.000	366