

MCDONALDS CORP Euribor3m 08/19 / XS1237187718

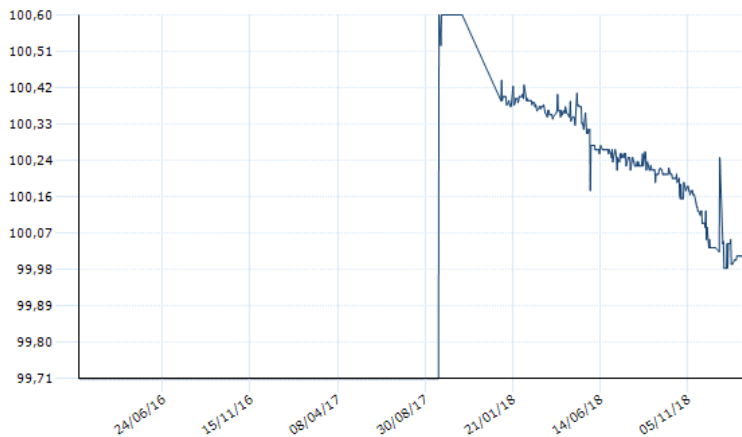
Grado di rischio calcolato

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
100,01 EUR	McDonald's	26/08/2019	0,000%	-0,019%	-0,019%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,01
Rendimento lordo	-0,01875
Rendimento netto	-0,01875
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	0,52603
Duration modificata	0,02663
Convessità	0,02734
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Börse Berlin

Dati anagrafici principali

Ente emittente	McDonald's
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	600.000.000
Nominale obbligazione	100.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	26/05/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	26/05/2015
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	26/08/2019
Data estinzione	26/08/2019
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	99,9900	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,0300	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,0000	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	100,0100	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	100,0710	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,0000	EUR

Formula di indicizzazione

$$TV = (\text{Euribor } 3m + 0.30) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2\text{gg).}$$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
26/02/2019	0,000	0,000	Certa	600.000.000	0	92
27/05/2019	0,000	0,000	Prevista	600.000.000	0	90
26/08/2019	0,000	0,000	Prevista	600.000.000	600.000.000	91

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
26/05/2015	26/08/2019	EURIBOR3M	1,000	0,300