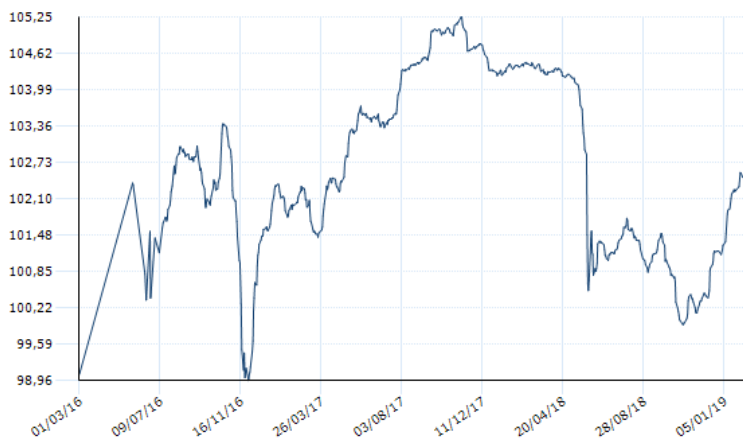


Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
102,37 EUR	Banco BPM	27/07/2020	2,750%	1,083%	0,363%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	102,368
Rendimento lordo	1,08342
Rendimento netto	0,36314
Cedola in corso	2,75000
Rateo lordo	1,52945
Rateo netto	1,13179
Vita residua	1,44658
Duration modificata	1,40508
Convessità	3,38925
Cedola successiva	2,75000
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	1.000.000,000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	27/07/2015
Prezzo emissione	99,5490
Decorrenza prima cedola regolare	27/07/2015
Tasso annuale	2,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	27/07/2020
Data estinzione	27/07/2020
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
ExtraMOT	13/02/2019	102,3970	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	102,3680	EUR
Euro TLX	13/02/2019	102,3800	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	102,3950	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
27/07/2019	2,750	2,750	Certa	1.000.000,000	0	365
27/07/2020	2,750	2,750	Certa	1.000.000,000	1.000.000,000	366