

M.PASCHI T2 call TF+TV 01/28 / XS1752894292

Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Illiquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
48,27 EUR	Banca Monte dei Paschi di Siena	18/01/2028	5,375%	16,910%	14,658%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	48,27
Rendimento lordo	16,90951
Rendimento netto	14,65811
Cedola in corso	5,37500
Rateo lordo	0,41233
Rateo netto	0,30512
Vita residua	8,92877
Duration modificata	3,10216
Convessità	12,72554
Cedola successiva	5,37500
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Banca Monte dei Paschi di Siena
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	750.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	18/01/2018
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	18/01/2018
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	SI

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	18/01/2028
Data estinzione	18/01/2028
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
ExtraMOT PRO	13/02/2019	49,0900	EUR
Bourse de Luxembourg	08/02/2019	45,7430	EUR
Euro TLX	13/02/2019	48,2700	EUR

Formula di indicizzazione

Primi 5 anni tasso fisso annuo del 5.375%. Poi:
 $TV = (CMSEUR5a + 5.005)$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/01/2020	5,375	5,375	Certa	750.000.000	0	365
18/01/2021	5,375	5,375	Certa	750.000.000	0	366
18/01/2022	5,375	5,375	Certa	750.000.000	0	365
18/01/2023	5,375	5,375	Certa	750.000.000	0	365
18/01/2024	0,000	5,162	Prevista	750.000.000	0	365
18/01/2025	0,000	5,162	Prevista	750.000.000	0	366
18/01/2026	0,000	5,162	Prevista	750.000.000	0	365
18/01/2027	0,000	5,162	Prevista	750.000.000	0	365
18/01/2028	0,000	5,162	Prevista	750.000.000	750.000.000	365

Annotazioni

Clausola di subordinazione: Tier II
 In caso di liquidazione dell'Emittente, il presente prestito sarà rimborsato solo dopo che siano stati soddisfatti tutti gli altri creditori non ugualmente subordinati.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
---	18/01/2023	18/01/2023	100	30

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
18/01/2023	18/01/2028	IRS5YEUR	1,000	5,005