

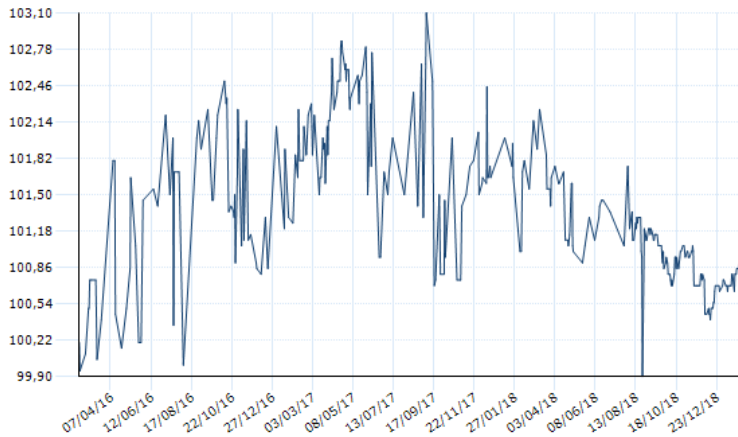
FIRST GULF BANK 0.625% 05/22 / CH0278875940
Grado di rischio calcolato

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
101,35 CHF	First Gulf Bank PJSC	27/05/2022	0,625%	0,212%	0,051%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	101,35
Rendimento lordo	0,21218
Rendimento netto	0,05094
Cedola in corso	0,62500
Rateo lordo	0,44792
Rateo netto	0,33146
Vita residua	3,27945
Duration modificata	3,23581
Convessità	13,78361
Cedola successiva	0,62500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	First Gulf Bank PJSC
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	CHF
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	200.000.000
Nominale obbligazione	5.000,00
Taglio minimo	5.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	27/05/2015
Prezzo emissione	100,3590
Decorrenza prima cedola regolare	27/05/2015
Tasso annuale	0,6250
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	27/05/2022
Data estinzione	27/05/2022
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	101,6500	CHF
Frankfurter Börse	13/02/2019	101,3500	CHF

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
27/05/2019	0,625	0,625	Certa	200.000.000	0	365
27/05/2020	0,625	0,625	Certa	200.000.000	0	366
27/05/2021	0,625	0,625	Certa	200.000.000	0	365
27/05/2022	0,625	0,625	Certa	200.000.000	200.000.000	365