

**KINGDOM OF SPAIN 2.75% 10/24 / ES00000126B2**
**Grado di rischio calcolato**

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

**Grado Liquidità**

Molto liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
112,62 EUR	Kingdom of Spain	31/10/2024	2,750%	0,501%	0,176%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	112,62
Rendimento lordo	0,50057
Rendimento netto	0,17632
Cedola in corso	2,75000
Rateo lordo	0,80616
Rateo netto	0,70539
Vita residua	5,71233
Duration modificata	5,32549
Convessità	34,84211
Cedola successiva	2,75000
Mercato di riferimento	Euro TLX

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	Kingdom of Spain
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	9.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	20/06/2014
Prezzo emissione	99,5640
Decorrenza prima cedola regolare	31/10/2014
Data Prorata	20/06/2014
Tasso annuale	2,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	31/10/2024
Data estinzione	31/10/2024
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 12,5%

**Mercati di quotazione**

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	13/02/2019	112,5100	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	112,5800	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	112,5300	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	112,5400	EUR
EuroMOT	13/02/2019	112,6400	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	112,5570	EUR
Euro TLX	13/02/2019	112,6200	EUR

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
31/10/2019	2,750	2,750	Certa	9.000.000.000	0	365
31/10/2020	2,750	2,750	Certa	9.000.000.000	0	366
31/10/2021	2,750	2,750	Certa	9.000.000.000	0	365
31/10/2022	2,750	2,750	Certa	9.000.000.000	0	365
31/10/2023	2,750	2,750	Certa	9.000.000.000	0	365
31/10/2024	2,750	2,750	Certa	9.000.000.000	9.000.000.000	366