

BRAZIL 04/06/97-27 10.125% 05/27 / US105756AE07

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
137,12 USD	Republic of Brazil	15/05/2027	5,063%	4,705%	3,644%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	137,12
Rendimento lordo	4,70525
Rendimento netto	3,64430
Cedola in corso	5,06250
Rateo lordo	2,53125
Rateo netto	2,21484
Vita residua	8,24932
Duration modificata	5,79892
Convessità	46,11620
Cedola successiva	5,06250
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Brazil
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	3.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Minus + pro-rata
Data emissione	09/06/1997
Prezzo emissione	98,3500
Decorrenza prima cedola regolare	15/11/1997
Data Prorata	09/06/1997
Tasso annuale	10,1250
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/05/2027
Data estinzione	15/05/2027
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	139,7500	USD
Frankfurter Börse	13/02/2019	137,8900	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	137,0900	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	137,0700	USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	137,6360	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	136,4100	USD
Euro TLX	13/02/2019	137,1200	USD
Hi-MTF	13/02/2019	137,8750	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/05/2019	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	181
15/11/2019	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	184
15/05/2020	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	182
15/11/2020	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	184
15/05/2021	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	181
15/11/2021	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	184
15/05/2022	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	181
15/11/2022	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	184
15/05/2023	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	181
15/11/2023	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	184
15/05/2024	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	182
15/11/2024	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	184
15/05/2025	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	181
15/11/2025	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	184
15/05/2026	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	181
15/11/2026	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	0	184
15/05/2027	5,063	5,063	Certa	3.000.000.000	3.000.000.000	181