

BRAZIL 12.75% 01/20 / US105756AK66

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
108,8 USD	Republic of Brazil	15/01/2020	6,375%	2,926%	1,427%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	108,8
Rendimento lordo	2,92643
Rendimento netto	1,42654
Cedola in corso	6,37500
Rateo lordo	1,06250
Rateo netto	0,92969
Vita residua	0,91507
Duration modificata	0,86130
Convessità	1,59134
Cedola successiva	6,37500
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	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Minus + pro-rata
Data emissione	26/01/2000
Prezzo emissione	96,3940
Decorrenza prima cedola regolare	15/07/2000
Data Prorata	26/01/2000
Tasso annuale	12,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/01/2020
Data estinzione	15/01/2020
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	148,0000	USD
Frankfurter Börse	13/02/2019	108,6680	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	108,4000	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	108,4900	USD
Börse Berlin	13/02/2019	108,4300	USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	108,7320	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	107,9500	USD
Euro TLX	13/02/2019	108,8000	USD
Hi-MTF	13/02/2019	108,8500	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/07/2019	6,375	6,375	Certa	1.000.000.000	0	181
15/01/2020	6,375	6,375	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	184