

COUNCIL OF EUROPE 1.75% 11/19 / US222213AK66
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
99,33 USD	Council of Europe Devel. Bank	14/11/2019	0,875%	2,639%	2,415%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,33
Rendimento lordo	2,63909
Rendimento netto	2,41510
Cedola in corso	0,87500
Rateo lordo	0,44236
Rateo netto	0,38707
Vita residua	0,74521
Duration modificata	0,72200
Convessità	1,22664
Cedola successiva	0,87500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Council of Europe Devel. Bank
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	Regular
Data emissione	14/11/2014
Prezzo emissione	99,7570
Decorrenza prima cedola regolare	14/11/2014
Tasso annuale	1,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	14/11/2019
Data estinzione	14/11/2019
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	99,3300	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	99,2500	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	99,3500	USD
Börse Berlin	13/02/2019	99,2600	USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	99,3340	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	99,3300	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
14/05/2019	1,750	0,875	Certa	1.000.000.000	0	181
14/11/2019	1,750	0,875	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	184