

EBRD USD 1.50% 03/20 / US29874QCH56

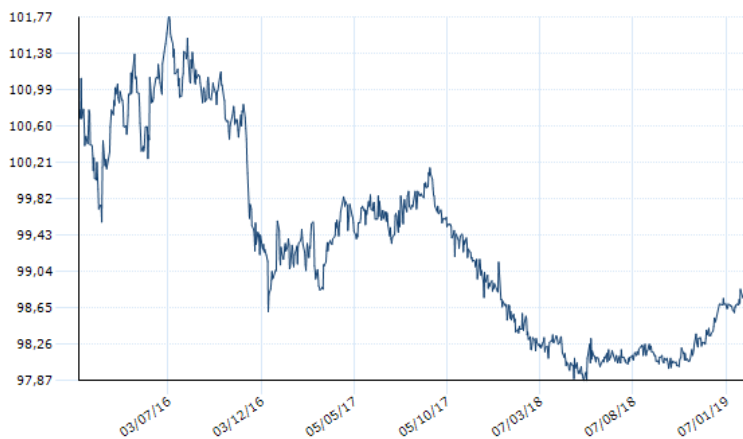
Grado di rischio calcolato

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
98,8 USD	E.B.R.D.	16/03/2020	0,750%	2,654%	2,454%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,8
Rendimento lordo	2,65427
Rendimento netto	2,45447
Cedola in corso	0,75000
Rateo lordo	0,62083
Rateo netto	0,54323
Vita residua	1,08219
Duration modificata	1,04329
Convessità	2,11350
Cedola successiva	0,75000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	E.B.R.D.
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.425.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	04/02/2013
Prezzo emissione	99,4960
Decorrenza prima cedola regolare	16/09/2013
Data Prorata	04/02/2013
Tasso annuale	1,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	16/03/2020
Data estinzione	16/03/2020
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	98,7560	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	98,7800	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	98,7800	USD
EuroMOT	13/02/2019	98,8020	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	98,7800	USD
Euro TLX	13/02/2019	98,8000	USD
Hi-MTF	13/02/2019	98,8950	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
16/03/2019	1,500	0,750	Certa	1.425.000.000	0	181
16/09/2019	1,500	0,750	Certa	1.425.000.000	0	184
16/03/2020	1,500	0,750	Certa	1.425.000.000	1.425.000.000	182