

REP. OF SOUTH AFRICA 4.665% 01/24 / US836205AQ75

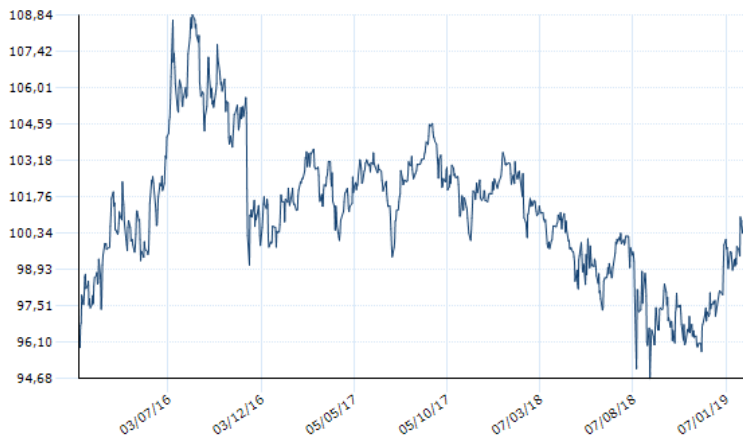
Grado di rischio calcolato

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
100,05 USD	Republic of South Africa	17/01/2024	2,333%	4,706%	4,111%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,05
Rendimento lordo	4,70603
Rendimento netto	4,11064
Cedola in corso	2,33250
Rateo lordo	0,36283
Rateo netto	0,31748
Vita residua	4,92329
Duration modificata	4,24064
Convessità	23,24100
Cedola successiva	2,33250
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	17/01/2012
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	17/01/2012
Tasso annuale	4,6650
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	17/01/2024
Data estinzione	17/01/2024
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	99,1950 USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	99,6500 USD
Börse Berlin	13/02/2019	99,6200 USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	99,7950 USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	99,6300 USD
Euro TLX	13/02/2019	100,0500 USD
Hi-MTF	13/02/2019	99,9650 USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
17/07/2019	4,665	2,333	Certa	1.500.000.000	0	181
17/01/2020	4,665	2,333	Certa	1.500.000.000	0	184
17/07/2020	4,665	2,333	Certa	1.500.000.000	0	182
17/01/2021	4,665	2,333	Certa	1.500.000.000	0	184
17/07/2021	4,665	2,333	Certa	1.500.000.000	0	181
17/01/2022	4,665	2,333	Certa	1.500.000.000	0	184
17/07/2022	4,665	2,333	Certa	1.500.000.000	0	181
17/01/2023	4,665	2,333	Certa	1.500.000.000	0	184
17/07/2023	4,665	2,333	Certa	1.500.000.000	0	181
17/01/2024	4,665	2,333	Certa	1.500.000.000	1.500.000.000	184