

BANK OF AMERICA CO. 5.50% 12/19 / XS0181389304
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
103,26 GBP	Bank of America Corp	04/12/2019	2,750%	1,366%	-0,015%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	103,26
Rendimento lordo	1,36571
Rendimento netto	-0,01520
Cedola in corso	2,75000
Rateo lordo	1,10302
Rateo netto	0,81624
Vita residua	0,80000
Duration modificata	0,77637
Convessità	1,37481
Cedola successiva	2,75000
Mercato di riferimento	Bayerische Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Bank of America Corp
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	GBP
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	04/12/2003
Prezzo emissione	99,5060
Decorrenza prima cedola regolare	04/12/2003
Tasso annuale	5,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	04/12/2019
Data estinzione	04/12/2019
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	13/02/2019	103,2700	GBP
Bayerische Börse	13/02/2019	103,2600	GBP
Börse Berlin	13/02/2019	103,2880	GBP
LSE London Stock Exchange	13/02/2019	103,3300	GBP
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	103,3230	GBP

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
04/06/2019	5,500	2,750	Certa	500.000.000	0	182
04/12/2019	5,500	2,750	Certa	500.000.000	500.000.000	183