

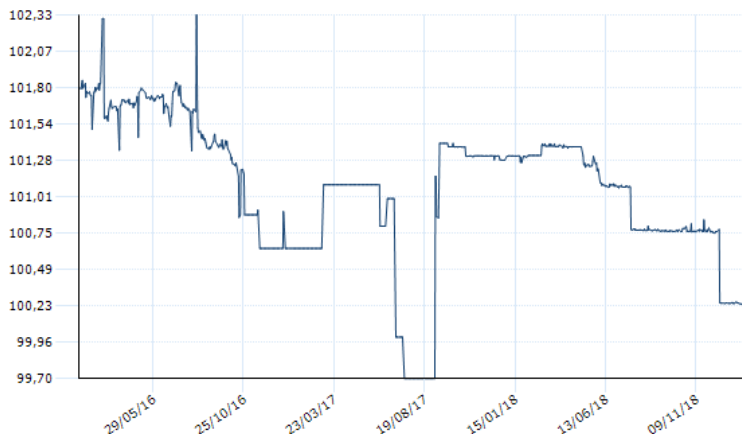
Grado di rischio calcolato

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
100,23 EUR	Republic of Austria	22/04/2020	0,218%	0,244%	0,190%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,226
Rendimento lordo	0,24395
Rendimento netto	0,18959
Cedola in corso	0,21800
Rateo lordo	0,13895
Rateo netto	0,12158
Vita residua	1,18356
Duration modificata	0,19304
Convessità	0,23030
Cedola successiva	0,21800
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Austria
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	200.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	22/04/2005
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	22/04/2005
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	22/04/2020
Data estinzione	22/04/2020
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	100,2260	EUR
MOT	13/02/2019	100,5750	EUR
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	100,6260	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,3780	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,6900	EUR

Formula di indicizzazione

TV= (Euribor 6m + 0.70)/2 (puntuale 2gg)
 se CMSEUR10a >= CMSEUR2a
 0.00% Altrimenti

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
22/04/2019	0,000	0,218	Certa	200.000.000	0	182
22/10/2019	0,000	0,218	Prevista	200.000.000	0	183
22/04/2020	0,000	0,218	Prevista	200.000.000	200.000.000	183

Annotazioni

La somma complessiva delle cedole pagate non può essere inferiore al 30% (minimo garantito).

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
22/04/2005	22/04/2020	EURIBOR6M	1,000	0,700