

REP. OF AUSTRIA DeltaCms 10/35 / XS0231558858

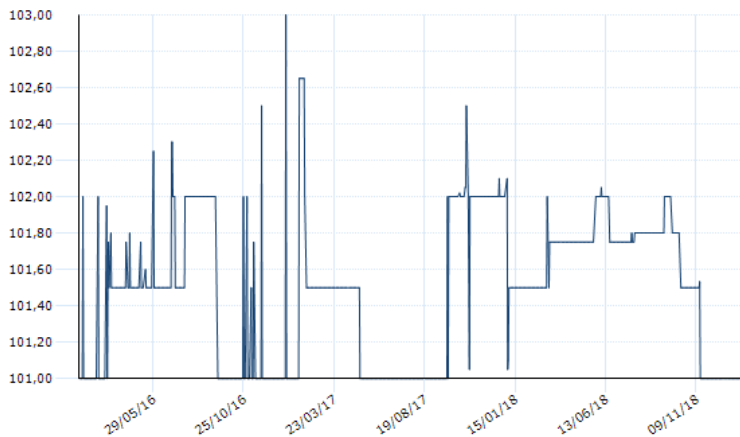
Grado di rischio calcolato

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
101 EUR	Republic of Austria	24/10/2035	0,099%	0,039%	0,027%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	101
Rendimento lordo	0,03884
Rendimento netto	0,02654
Cedola in corso	0,09900
Rateo lordo	0,03092
Rateo netto	0,02706
Vita residua	16,69863
Duration modificata	0,77984
Convessità	1,38800
Cedola successiva	0,09900
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Austria
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	75.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	24/10/2005
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	24/10/2005
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola massima %	7,00
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	24/10/2035
Data estinzione	24/10/2035
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	101,0000	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	101,5000	EUR
MOT	13/02/2019	102,2300	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	101,4900	EUR

Formula di indicizzazione

Primi 5 anni tasso fisso annuo "Step-down". Poi:
 $TV = (4,00\% * (CMSEUR10a - CMSEUR2a))$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
24/10/2019	0,099	0,099	Certa	75.000.000	0	365
24/10/2020	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	366
24/10/2021	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	365
24/10/2022	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	365
24/10/2023	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	365
24/10/2024	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	366
24/10/2025	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	365
24/10/2026	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	365
24/10/2027	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	365
24/10/2028	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	366
24/10/2029	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	365
24/10/2030	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	365
24/10/2031	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	365
24/10/2032	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	366
24/10/2033	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	365
24/10/2034	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	0	365
24/10/2035	0,000	0,099	Prevista	75.000.000	75.000.000	365

Annotazioni

Opzione di "Conversione calcolo tasso variabile".
 Dal 24/10/2010 l'Emittente ha la facoltà di modificare la modalità di calcolo del tasso applicabile all'obbligazione, previa comunicazione agli obbligazionisti 10 gg antecedenti ogni stacco cedola, trasformandolo in tasso variabile legato all'Euribor 12m pagabile sempre annualmente:
 $Cedola = (Euribor\ 12m + 0,25) * act/act$ (puntuale 2gg)
 L'opzione è esercitabile una volta sola e sarà valida fino a scadenza (in questo caso non è applicabile il limite massimo di cedola).
 Floor Globale: 60% pagato a scadenza.

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
24/10/2010	24/10/2035	IRS10YEUR	4,000	0,000
24/10/2010	24/10/2035	IRS2YEUR	-4,000	0,000