

REP. OF EGYPT 6.875% 04/40 / XS0505478684
Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Grado Liquidità

Poco liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
88,48 USD	Republic of Egypt	30/04/2040	3,438%	8,168%	7,194%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	88,48
Rendimento lordo	8,16844
Rendimento netto	7,19375
Cedola in corso	3,43750
Rateo lordo	2,00521
Rateo netto	1,75456
Vita residua	21,21918
Duration modificata	9,81696
Convessità	153,53147
Cedola successiva	3,43750
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	29/04/2010
Prezzo emissione	99,0590
Decorrenza prima cedola regolare	30/10/2010
Data Prorata	29/04/2010
Tasso annuale	6,8750
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	30/04/2040
Data estinzione	30/04/2040
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	87,0200	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	87,9200	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	87,7900	USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	87,4140	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	87,8900	USD
Euro TLX	13/02/2019	88,4800	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
30/04/2019	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	182
30/10/2019	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
30/04/2020	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
30/10/2020	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
30/04/2021	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	182
30/10/2021	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
30/04/2022	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	182
30/10/2022	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
30/04/2023	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	182
30/10/2023	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
30/04/2024	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
30/10/2024	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
30/04/2025	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	182
30/10/2025	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
30/04/2026	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	182
30/10/2026	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
30/04/2027	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	182
30/10/2027	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
30/04/2028	6,875	3,438	Certa	500.000.000	0	183
.....						
30/04/2040	6,875	3,438	Certa	500.000.000	500.000.000	183