

VIMPELCOM HOLDING 7.504% 03/22 / XS0643183220
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
108,98 USD	Veon Holdings	01/03/2022	3,752%	4,375%	2,490%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	108,98
Rendimento lordo	4,37475
Rendimento netto	2,49031
Cedola in corso	3,75200
Rateo lordo	3,41849
Rateo netto	2,52968
Vita residua	3,04110
Duration modificata	2,59038
Convessità	9,76560
Cedola successiva	3,75200
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Veon Holdings
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.280.023.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	200.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	29/06/2011
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	01/03/2012
Data Prorata	29/06/2011
Tasso annuale	7,5040
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/03/2022
Data estinzione	01/03/2022
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	108,9800	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	108,7500	USD
Hi-MTF	13/02/2019	109,5000	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	7,504	3,752	Certa	1.280.023.000	0	181
01/09/2019	7,504	3,752	Certa	1.280.023.000	0	184
01/03/2020	7,504	3,752	Certa	1.280.023.000	0	182
01/09/2020	7,504	3,752	Certa	1.280.023.000	0	184
01/03/2021	7,504	3,752	Certa	1.280.023.000	0	181
01/09/2021	7,504	3,752	Certa	1.280.023.000	0	184
01/03/2022	7,504	3,752	Certa	1.280.023.000	1.280.023.000	181