

RUSSIAN FEDERATION 5.875% 09/43 / XS0971721963
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
109,97 USD	Russian Federation	16/09/2043	2,938%	5,219%	4,512%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	109,97
Rendimento lordo	5,21854
Rendimento netto	4,51210
Cedola in corso	2,93750
Rateo lordo	2,43160
Rateo netto	2,12765
Vita residua	24,60000
Duration modificata	12,86515
Convessità	247,92385
Cedola successiva	2,93750
Mercato di riferimento	Börse Berlin

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Russian Federation
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.500.000,00
Nominale obbligazione	200.000,00
Taglio minimo	200.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	16/09/2013
Prezzo emissione	97,1870
Decorrenza prima cedola regolare	16/09/2013
Tasso annuale	5,8750
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	16/09/2043
Data estinzione	16/09/2043
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	109,7800	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	109,8300	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	109,7800	USD
Börse Berlin	13/02/2019	109,9700	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	109,8100	USD
Euro TLX	13/02/2019	110,4200	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
16/03/2019	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	181
16/09/2019	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	184
16/03/2020	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	182
16/09/2020	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	184
16/03/2021	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	181
16/09/2021	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	184
16/03/2022	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	181
16/09/2022	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	184
16/03/2023	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	181
16/09/2023	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	184
16/03/2024	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	182
16/09/2024	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	184
16/03/2025	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	181
16/09/2025	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	184
16/03/2026	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	181
16/09/2026	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	184
16/03/2027	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	181
16/09/2027	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	184
16/03/2028	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	0	182
16/09/2043	5,875	2,938	Certa	1.500.000.000	1.500.000.000	184