

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
110,86 EUR	Republic of Croatia	30/05/2022	3,875%	0,530%	0,065%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	110,86
Rendimento lordo	0,53018
Rendimento netto	0,06500
Cedola in corso	3,87500
Rateo lordo	2,77089
Rateo netto	2,42453
Vita residua	3,28767
Duration modificata	3,06801
Convessità	12,89383
Cedola successiva	3,87500
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Croatia
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.250.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	29/05/2014
Prezzo emissione	99,0440
Decorrenza prima cedola regolare	30/05/2015
Data Prorata	29/05/2014
Tasso annuale	3,8750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	30/05/2022
Data estinzione	30/05/2022
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	110,4000	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	110,2500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	110,5600	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	110,5600	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	110,6880	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	110,5600	EUR
Euro TLX	13/02/2019	110,8600	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
30/05/2019	3,875	3,875	Certa	1.250.000.000	0	365
30/05/2020	3,875	3,875	Certa	1.250.000.000	0	366
30/05/2021	3,875	3,875	Certa	1.250.000.000	0	365
30/05/2022	3,875	3,875	Certa	1.250.000.000	1.250.000.000	365