

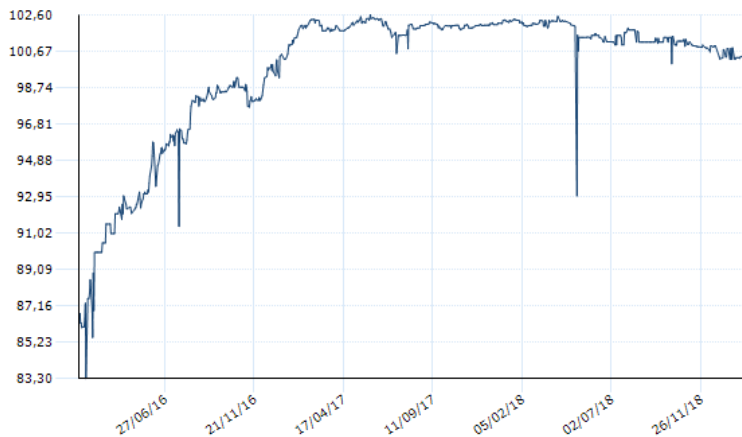
NKH KAZAGRO AO 3.255% 05/19 / XS1070363343
Grado di rischio calcolato

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
100,31 EUR	NKH Kazagro AO	22/05/2019	3,255%	1,994%	1,188%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,31
Rendimento lordo	1,99390
Rendimento netto	1,18842
Cedola in corso	3,25500
Rateo lordo	2,39889
Rateo netto	1,77518
Vita residua	0,26301
Duration modificata	0,25790
Convessità	0,31936
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	NKH Kazagro AO
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	600.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	22/05/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	22/05/2014
Tasso annuale	3,2550
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	22/05/2019
Data estinzione	22/05/2019
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	100,3100	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,3000	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,3000	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	99,3800	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,3000	EUR

Formula di indicizzazione
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
22/05/2019	3,255	3,255	Certa	600.000.000	600.000.000	365