

Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Molto liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
100,45 EUR	Republic of Austria	04/06/2020	0,000%	-0,344%	-0,344%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,45
Rendimento lordo	-0,34442
Rendimento netto	-0,34442
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	1,30137
Duration modificata	0,29960
Convessità	0,38936
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Austria
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	04/06/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	04/06/2014
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	04/06/2020
Data estinzione	04/06/2020
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	100,4500	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,4500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,4590	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	100,4500	EUR
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	100,5350	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,4510	EUR

Formula di indicizzazione

 $TV = (\text{Euribor } 3m - 0,04) * \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2\text{gg)}$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
04/06/2019	0,000	0,000	Certa	2.000.000.000	0	182
04/12/2019	0,000	0,000	Prevista	2.000.000.000	0	183
04/06/2020	0,000	0,000	Prevista	2.000.000.000	2.000.000.000	183

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
04/06/2014	04/06/2020	EURIBOR3M	1,000	-0,040