

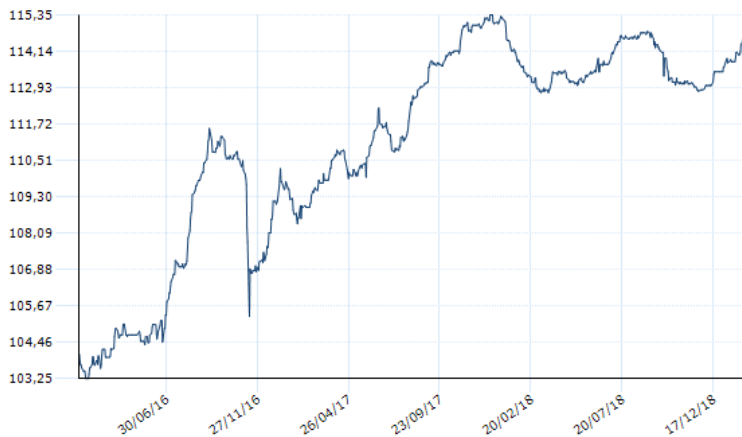
REP. OF BULGARIA 2.95% 09/24 / XS1083844503
Grado di rischio calcolato

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
114,78 EUR	Republic of Bulgaria	03/09/2024	2,950%	0,263%	-0,086%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	114,78
Rendimento lordo	0,26254
Rendimento netto	-0,08644
Cedola in corso	2,95000
Rateo lordo	1,33356
Rateo netto	1,16687
Vita residua	5,55342
Duration modificata	5,16045
Convessità	33,02079
Cedola successiva	2,95000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.493.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	03/07/2014
Prezzo emissione	99,0850
Decorrenza prima cedola regolare	03/09/2015
Data Prorata	03/07/2014
Tasso annuale	2,9500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	03/09/2024
Data estinzione	03/09/2024
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	114,7800	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	114,7500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	114,7800	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	114,8930	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	114,7800	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
03/09/2019	2,950	2,950	Certa	1.493.000.000	0	365
03/09/2020	2,950	2,950	Certa	1.493.000.000	0	366
03/09/2021	2,950	2,950	Certa	1.493.000.000	0	365
03/09/2022	2,950	2,950	Certa	1.493.000.000	0	365
03/09/2023	2,950	2,950	Certa	1.493.000.000	0	365
03/09/2024	2,950	2,950	Certa	1.493.000.000	1.493.000.000	366