

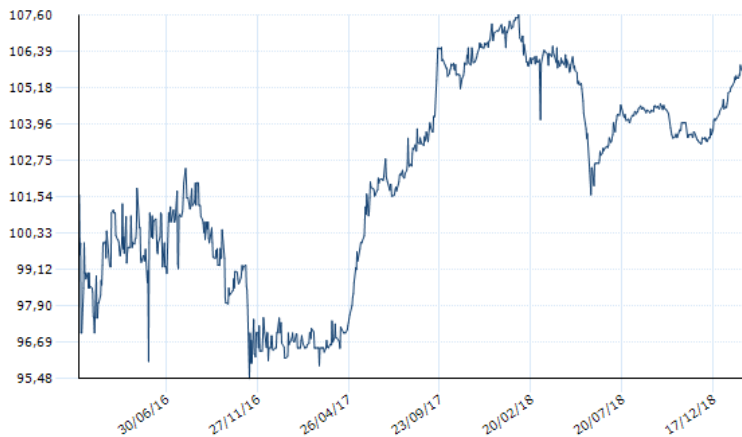
REP. OF PORTUGAL 5.125% 10/24 / XS1085735899
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Altamente liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
105,72 USD	Republic of Portugal	15/10/2024	2,563%	4,025%	3,387%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	105,72
Rendimento lordo	4,02472
Rendimento netto	3,38657
Cedola in corso	2,56250
Rateo lordo	1,70833
Rateo netto	1,49479
Vita residua	5,66849
Duration modificata	4,74390
Convessità	29,21678
Cedola successiva	2,56250
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Portugal
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	4.500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	10/07/2014
Prezzo emissione	99,2210
Decorrenza prima cedola regolare	15/10/2014
Data Prorata	10/07/2014
Tasso annuale	5,1250
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/10/2024
Data estinzione	15/10/2024
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	105,7200	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	106,1800	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	106,1800	USD
Börse Berlin	13/02/2019	106,1000	USD
EuroMOT	13/02/2019	106,2600	USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	106,1850	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	106,0300	USD
Euro TLX	13/02/2019	106,3500	USD
Hi-MTF	13/02/2019	106,7500	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/04/2019	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	0	182
15/10/2019	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	0	183
15/04/2020	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	0	183
15/10/2020	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	0	183
15/04/2021	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	0	182
15/10/2021	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	0	183
15/04/2022	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	0	182
15/10/2022	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	0	183
15/04/2023	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	0	182
15/10/2023	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	0	183
15/04/2024	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	0	183
15/10/2024	5,125	2,563	Certa	4.500.000.000	4.500.000.000	183