

REP. OF ECUADOR 10.50% 03/20 / XS1199929826

Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Poco liquido

12/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
103,61 USD	Republic of Ecuador	24/03/2020	5,250%	7,207%	5,886%



Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	103,607
Rendimento lordo	7,20744
Rendimento netto	5,88631
Cedola in corso	5,25000
Rateo lordo	4,08333
Rateo netto	3,57292
Vita residua	1,10685
Duration modificata	0,96557
Convessità	1,88071
Cedola successiva	5,25000
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	200.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	24/03/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	24/03/2015
Tasso annuale	10,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	24/03/2020
Data estinzione	24/03/2020
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	12/02/2019	103,3020	USD
Börse Berlin	12/02/2019	103,2900	USD
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	103,6070	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	103,5000	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
24/03/2019	10,500	5,250	Certa	1.500.000.000	0	181
24/09/2019	10,500	5,250	Certa	1.500.000.000	0	184
24/03/2020	10,500	5,250	Certa	1.500.000.000	1.500.000.000	182