

SG ISSUER SA USD TF+TV 10/23 / XS1265876430
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
96,98 USD	SG Issuer SA	23/10/2023	0,693%	3,497%	2,753%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	96,98
Rendimento lordo	3,49717
Rendimento netto	2,75269
Cedola in corso	0,69300
Rateo lordo	0,17710
Rateo netto	0,13105
Vita residua	4,68767
Duration modificata	0,09128
Convessità	0,09962
Cedola successiva	0,68800
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	SG Issuer SA
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	80.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	23/10/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	23/10/2015
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola minima %	0,31
Cedola massima %	1,25
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	23/10/2023
Data estinzione	23/10/2023
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
EuroMOT	13/02/2019	96,7700 USD
Euro TLX	13/02/2019	96,9800 USD

Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso trimestrale dell'1.25%.
 Poi cedole trimestrali variabili così calcolate:
 $TV = (\text{USDLibor } 3m) / 4$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
23/04/2019	0,000	0,693	Certa	80.000.000	0	90
23/07/2019	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	91
23/10/2019	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	92
23/01/2020	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	92
23/04/2020	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	91
23/07/2020	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	91
23/10/2020	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	92
25/01/2021	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	94
23/04/2021	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	88
23/07/2021	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	91
25/10/2021	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	94
24/01/2022	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	91
25/04/2022	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	91
25/07/2022	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	91
24/10/2022	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	91
23/01/2023	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	91
24/04/2023	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	91
24/07/2023	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	0	91
23/10/2023	0,000	0,688	Prevista	80.000.000	80.000.000	91

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
23/10/2017	23/10/2023	USDLIBOR3M	1,000	0,000