

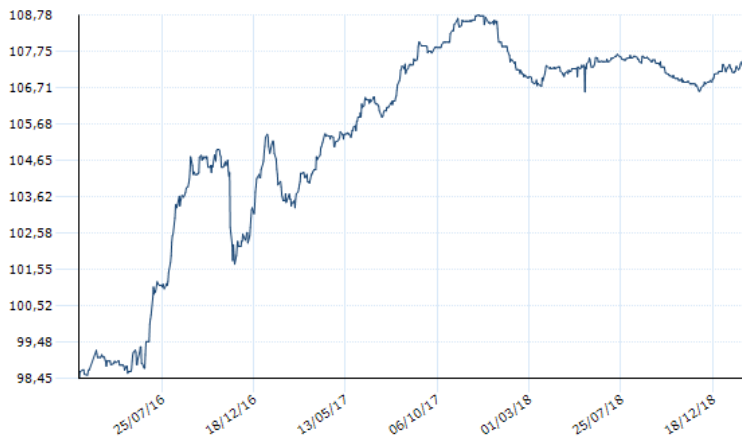
REP. OF BULGARIA 1.875% 03/23 / XS1382693452
Grado di rischio calcolato

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
107,29 EUR	Republic of Bulgaria	21/03/2023	1,875%	0,090%	-0,165%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	107,29
Rendimento lordo	0,08982
Rendimento netto	-0,16529
Cedola in corso	1,87500
Rateo lordo	1,70034
Rateo netto	1,48780
Vita residua	4,09589
Duration modificata	3,92060
Convessità	19,77317
Cedola successiva	1,87500
Mercato di riferimento	Börse Berlin

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.144.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	21/03/2016
Prezzo emissione	98,1920
Decorrenza prima cedola regolare	21/03/2016
Tasso annuale	1,8750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	21/03/2023
Data estinzione	21/03/2023
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	107,2500	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	107,2800	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	107,2900	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	107,5980	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	107,2700	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
21/03/2019	1,875	1,875	Certa	1.144.000.000	0	365
21/03/2020	1,875	1,875	Certa	1.144.000.000	0	366
21/03/2021	1,875	1,875	Certa	1.144.000.000	0	365
21/03/2022	1,875	1,875	Certa	1.144.000.000	0	365
21/03/2023	1,875	1,875	Certa	1.144.000.000	1.144.000.000	365