

## Grado di rischio calcolato

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

## Grado Liquidità

Liquido

12/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
111,78 EUR	Republic of Cyprus	26/07/2023	3,750%	1,023%	0,582%



## Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	111,78
Rendimento lordo	1,02306
Rendimento netto	0,58204
Cedola in corso	3,75000
Rateo lordo	2,08562
Rateo netto	1,82491
Vita residua	4,44658
Duration modificata	4,08029
Convessità	21,54195
Cedola successiva	3,75000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

## Dati anagrafici principali

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

## Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	26/07/2016
Prezzo emissione	99,6980
Decorrenza prima cedola regolare	26/07/2016
Tasso annuale	3,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	26/07/2023
Data estinzione	26/07/2023
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	12/02/2019	111,7800	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	111,8000	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	112,2500	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	111,7900	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	111,7710	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	112,8700	EUR

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
26/07/2019	3,750	3,750	Certa	1.000.000.000	0	365
26/07/2020	3,750	3,750	Certa	1.000.000.000	0	366
26/07/2021	3,750	3,750	Certa	1.000.000.000	0	365
26/07/2022	3,750	3,750	Certa	1.000.000.000	0	365
26/07/2023	3,750	3,750	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	365