

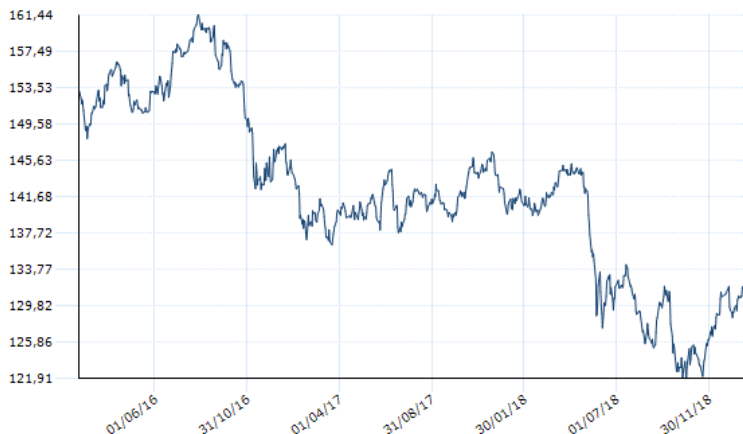
Grado di rischio calcolato

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
130,16 EUR	Republic of Italy	01/05/2031	3,000%	3,046%	2,399%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	130,16
Rendimento lordo	3,04605
Rendimento netto	2,39901
Cedola in corso	3,00000
Rateo lordo	1,75691
Rateo netto	1,53729
Vita residua	12,21370
Duration modificata	8,91184
Convessità	103,43767
Cedola successiva	3,00000
Mercato di riferimento	MOT

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	29.762.750.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/11/1999
Prezzo emissione	102,4000
Decorrenza prima cedola regolare	01/11/1999
Tasso annuale	6,0000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/05/2031
Data estinzione	01/05/2031
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
Bayerische Börse	13/02/2019	130,1520	EUR
MOT	13/02/2019	130,1600	EUR
Euro MTS	13/02/2019	130,1000	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	130,1950	EUR
Euro TLX	13/02/2019	130,3300	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	130,0000	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/05/2019	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	181	tr;1/2a:102.4tr3/4a:104.5;5/6a:101.90;7/8a:102.80;9/10:102.5;
01/11/2019	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	184	11/12a: 103.70; 13/14a: 102.55; 1.75 mld (12/09/2000)
01/05/2020	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	182	15/16a: 101.20; 0.75 mld (18/10/2000) 17/18a: 100.90; 0.75
01/11/2020	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	184	mld (17/11/2000) 19/20a: 105.02; 2.00 mld (15/01/2001)
01/05/2021	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	181	21/22a: 105.01; 2.00 mld (16/02/2001) 23/24a: 104.54; 1.25
01/11/2021	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	184	mld (16/03/2001) 25/26a: 103.37; 1.00 mld (17/04/2001)
01/05/2022	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	181	27/28a: 99.85; 1.00 mld (16/05/2001) 29/30a: 101.40; 1.00
01/11/2022	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	184	mld (18/06/2001) 31/32a: 101.18; 0.50 mld (17/07/2001)
01/05/2023	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	181	33/34a: 104.50; 0.50 mld (16/08/2001) 35/36a: 102.00; 0.75
01/11/2023	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	184	mld (17/09/2001) 39/40a: 110.78; 0.75 mld (14/11/2001)
01/05/2024	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	182	
01/11/2024	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	184	
01/05/2025	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	181	
01/11/2025	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	184	
01/05/2026	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	181	
01/11/2026	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	184	
01/05/2027	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	181	
01/11/2027	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	184	
01/05/2028	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	0	182	
.....							
01/05/2031	0,000	3,000	Certa	29.762.750.000	29.762.750.000	181	