

BTP 01/02/02-33 5.75% / IT0003256820

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
128,86 EUR	Republic of Italy	01/02/2033	2,875%	3,197%	2,574%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	128,86
Rendimento lordo	3,19743
Rendimento netto	2,57398
Cedola in corso	2,87500
Rateo lordo	0,22238
Rateo netto	0,19458
Vita residua	13,97260
Duration modificata	10,01133
Convessità	129,93914
Cedola successiva	2,87500
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	20.761.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/02/2002
Prezzo emissione	101,1500
Decorrenza prima cedola regolare	01/02/2002
Tasso annuale	5,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/02/2033
Data estinzione	01/02/2033
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	128,4000	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	128,7700	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	128,6620	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	127,9400	EUR
MOT	13/02/2019	128,8600	EUR
Euro MTS	13/02/2019	128,7200	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	128,7280	EUR
Euro TLX	13/02/2019	128,9000	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	128,9100	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/08/2019	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	181	1/2a: 101.15 3.000 mld (01/02/02)
01/02/2020	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	184	3/4a: 100.97 2.000 mld (15/05/02)
01/08/2020	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	182	5/6a: 109.19 1.000 mld (16/09/02)
01/02/2021	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	184	8/9a: 108.42 0.750 mld (18/11/02)
01/08/2021	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	181	10/11a:110.99 1.000 mld (15/01/03)
01/02/2022	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	184	12/13a:115.57 1.250 mld (17/03/03)
01/08/2022	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	181	14/15a:112.90 2.500 mld (16/05/03)
01/02/2023	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	184	
01/08/2023	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	181	
01/02/2024	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	184	
01/08/2024	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	182	
01/02/2025	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	184	
01/08/2025	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	181	
01/02/2026	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	184	
01/08/2026	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	181	
01/02/2027	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	184	
01/08/2027	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	181	
01/02/2028	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	184	
01/08/2028	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	0	182	
.....							
01/02/2033	0,000	2,875	Certa	20.761.000.000	20.761.000.000	184	