

BTP 01/08/03-34 5.00% / IT0003535157

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
121,45 EUR	Republic of Italy	01/08/2034	2,500%	3,251%	2,686%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	121,45
Rendimento lordo	3,25112
Rendimento netto	2,68585
Cedola in corso	2,50000
Rateo lordo	0,19337
Rateo netto	0,16920
Vita residua	15,46849
Duration modificata	11,04892
Convessità	157,57191
Cedola successiva	2,50000
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	25.110.921.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/08/2003
Prezzo emissione	98,1060
Decorrenza prima cedola regolare	01/08/2003
Tasso annuale	5,0000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/08/2034
Data estinzione	01/08/2034
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	121,0100	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	121,3700	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	121,2600	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	120,4700	EUR
MOT	13/02/2019	121,4500	EUR
Euro MTS	13/02/2019	122,2000	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	121,3120	EUR
Euro TLX	13/02/2019	121,5100	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	121,5600	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/08/2019	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	181
01/02/2020	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	184
01/08/2020	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	182
01/02/2021	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	184
01/08/2021	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	181
01/02/2022	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	184
01/08/2022	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	181
01/02/2023	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	184
01/08/2023	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	181
01/02/2024	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	184
01/08/2024	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	182
01/02/2025	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	184
01/08/2025	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	181
01/02/2026	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	184
01/08/2026	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	181
01/02/2027	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	184
01/08/2027	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	181
01/02/2028	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	184
01/08/2028	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	0	182
.....						
01/08/2034	5,000	2,500	Certa	25.110.921.000	25.110.921.000	181

Annotazioni

Risultati asta:
1/2a 98.106 7.000 mld 17/09/2003
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 99.60 2.500 mld 15/04/2004
5/6a 97.15 2.500 mld 17/05/2004
7/8a 102.55 2.500 mld 17/09/2004
11/12a 99.27 1.169.500 mld 16/11/2010
13/14a 118.07 392,250 mld 15/05/2014