

## 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
109,24 EUR	Republic of Italy	01/02/2037	2,000%	3,338%	2,857%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	109,24
Rendimento lordo	3,33772
Rendimento netto	2,85729
Cedola in corso	2,00000
Rateo lordo	0,15470
Rateo netto	0,13536
Vita residua	17,97534
Duration modificata	12,79352
Convessità	210,08234
Cedola successiva	2,00000
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	27.890.758.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/08/2005
Prezzo emissione	101,2890
Decorrenza prima cedola regolare	01/08/2005
Tasso annuale	4,0000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/02/2037
Data estinzione	01/02/2037
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	115,0000	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	108,7800	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	109,1400	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	109,0790	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	108,1300	EUR
MOT	13/02/2019	109,2400	EUR
Euro MTS	13/02/2019	109,2500	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	109,1920	EUR
Euro TLX	13/02/2019	109,2400	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	108,9800	EUR

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/08/2019	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	181	Risultati asta:
01/02/2020	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	184	1a 101.289 6.000 mld 19/10/2005
01/08/2020	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	182	Risultati riapertura:
01/02/2021	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	184	Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
01/08/2021	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	181	2/3a 103.100 2.500 mld 17/01/2006
01/02/2022	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	184	4/5a 98.350 2.000 mld 17/02/2006
01/08/2022	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	181	6/7a 89.750 2.000 mld 15/05/2006
01/02/2023	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	184	8/9a 89.390 2.000 mld 17/07/2006
01/08/2023	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	181	10/11a 92.810 2.000 mld 15/01/2007
01/02/2024	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	184	12/13a 89.260 2.500 mld 17/04/2007
01/08/2024	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	182	14/15a 83.850 1.500 mld 18/06/2007
01/02/2025	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	184	16/17a 82.900 1.500 mld 17/11/2008
01/08/2025	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	181	18/19a 87.300 1.262.000 mld 15/06/2010
01/02/2026	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	184	20/21a 92.610 1.154.435 mld 18/10/2010
01/08/2026	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	181	22/23a 100.380 750.000 mld 17/03/2014
01/02/2027	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	184	24/25a 105.430 607.750 mld 15/05/2014
01/08/2027	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	181	26/27a 116.230 774.500 mld 17/07/2017
01/02/2028	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	184	28/29a 103.230 558.300 mld 15/10/2018
01/08/2028	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	0	182	
01/02/2037	4,000	2,000	Certa	27.890.758.000	27.890.758.000	184	