

BTP 01/02/06-08/21 3.75% / IT0004009673

## 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
106,77 EUR	Republic of Italy	01/08/2021	1,875%	0,962%	0,498%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	106,77
Rendimento lordo	0,96169
Rendimento netto	0,49757
Cedola in corso	1,87500
Rateo lordo	0,14503
Rateo netto	0,12690
Vita residua	2,46027
Duration modificata	2,35354
Convessità	7,99100
Cedola successiva	1,87500
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	28.148.325.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/02/2006
Prezzo emissione	98,2600
Decorrenza prima cedola regolare	01/02/2006
Tasso annuale	3,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/08/2021
Data estinzione	01/08/2021
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	103,0600	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	106,6200	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	106,7500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	106,6940	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	106,4800	EUR
MOT	13/02/2019	106,7700	EUR
Euro MTS	13/02/2019	106,7300	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	106,7480	EUR
Euro TLX	13/02/2019	106,7200	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	106,6716	EUR

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/08/2019	3,750	1,875	Certa	28.148.325.000	0	181	1/2a: 98.26 5.000 mld (26/01/06)
01/02/2020	3,750	1,875	Certa	28.148.325.000	0	184	3/4a: 96.22 2.000 mld (15/03/06)
01/08/2020	3,750	1,875	Certa	28.148.325.000	0	182	5/6a: 93.86 2.000 mld (18/04/06)
01/02/2021	3,750	1,875	Certa	28.148.325.000	0	184	7/8a: 93.52 2.000 mld (16/06/06)
01/08/2021	3,750	1,875	Certa	28.148.325.000	28.148.325.000	181	96.907 1.415 mld (30/11/06) concambio 9/10a: 93.38 2.500 mld (16/02/07) 11/12a: 95.26 2.500 mld (16/03/07) 13/14a: 91.69 2.500 mld (17/05/07) 14/15a: 90.50 0.800 mln (17/02/09) 16/17a: 90.42 1.330,827 mld (15/06/09) 18/19a: 97.72 2.000 mld (17/11/09) 20/21a: 97.75 1.701,498 mld (16/02/10) 22/23a: 87.41 1.32 mld (03/10/11)