

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
121,81 EUR	Republic of Italy	01/08/2039	2,500%	3,527%	2,968%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	121,81
Rendimento lordo	3,52699
Rendimento netto	2,96784
Cedola in corso	2,50000
Rateo lordo	0,19337
Rateo netto	0,16920
Vita residua	20,47123
Duration modificata	13,31255
Convessità	237,31336
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	22.520.265.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/08/2007
Prezzo emissione	99,9800
Decorrenza prima cedola regolare	01/08/2007
Tasso annuale	5,0000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/08/2039
Data estinzione	01/08/2039
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	121,3100	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	121,7400	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	121,6160	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	120,5900	EUR
MOT	13/02/2019	121,8100	EUR
Euro MTS	13/02/2019	120,7000	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	121,6780	EUR
Euro TLX	13/02/2019	121,9500	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	121,7200	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/08/2019	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	181
01/02/2020	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	184
01/08/2020	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	182
01/02/2021	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	184
01/08/2021	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	181
01/02/2022	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	184
01/08/2022	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	181
01/02/2023	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	184
01/08/2023	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	181
01/02/2024	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	184
01/08/2024	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	182
01/02/2025	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	184
01/08/2025	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	181
01/02/2026	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	184
01/08/2026	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	181
01/02/2027	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	184
01/08/2027	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	181
01/02/2028	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	184
01/08/2028	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	0	182
01/08/2039	5,000	2,500	Certa	22.520.265.000	22.520.265.000	181

Annotazioni

Risultati asta:
1/ 99.98 5.000 mld 23/09/2007
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
2/3a 101.41 2.000 mld 15/10/2007
4/5a 98.83 2.000 mld 16/05/2008
6/7a 97.88 2.000 mld 15/09/2008
8/9a 96.80 1.416.500 mld 17/11/2008
10/11a 93.02 1.454 mld 16/01/2009
12/13a 92.25 1.461.500 mld 17/03/2009
14/15a 96.14 2.469.228 mld 18/05/2009
16/17a 141.86 552.900 mld 16/11/2016
18/19a 127.15 986.418 mld 15/02/2017