

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
113,17 EUR	Republic of Italy	01/08/2023	2,375%	1,681%	1,119%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	113,17
Rendimento lordo	1,68111
Rendimento netto	1,11912
Cedola in corso	2,37500
Rateo lordo	0,18370
Rateo netto	0,16074
Vita residua	4,46027
Duration modificata	4,02601
Convessità	21,04783
Cedola successiva	2,37500
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	24.799.152.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/02/2008
Prezzo emissione	99,1350
Decorrenza prima cedola regolare	01/02/2008
Tasso annuale	4,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/08/2023
Data estinzione	01/08/2023
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	116,4000	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	112,9700	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	113,1600	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	113,0930	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	112,7400	EUR
MOT	13/02/2019	113,1700	EUR
Euro MTS	13/02/2019	113,1900	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	113,1680	EUR
Euro TLX	13/02/2019	113,1970	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	112,9000	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/08/2019	4,750	2,375	Certa	24.799.152.000	0	181	1a : 99.135 4.00 mld (16/04/08)
01/02/2020	4,750	2,375	Certa	24.799.152.000	0	184	2/3a : 94.620 2.00 mld (16/06/08)
01/08/2020	4,750	2,375	Certa	24.799.152.000	0	182	4/5a : 95.620 1.50 mld (16/07/08)
01/02/2021	4,750	2,375	Certa	24.799.152.000	0	184	6/7a : 97.850 1.402,805 mld (16/12/08)
01/08/2021	4,750	2,375	Certa	24.799.152.000	0	181	8/9a : 97.350 2.182,060 mld (17/02/09)
01/02/2022	4,750	2,375	Certa	24.799.152.000	0	184	10/11a : 97.17 2.891,286 mld (15/04/09)
01/08/2022	4,750	2,375	Certa	24.799.152.000	0	181	12/13a : 97.15 2.250 mld (15/06/09)
01/02/2023	4,750	2,375	Certa	24.799.152.000	0	184	14/15a : 103.63 1.7555 mld (16/07/10)
01/08/2023	4,750	2,375	Certa	24.799.152.000	0	181	16/17a : 108.10 845,565 mld (18/10/10)
01/02/2023	4,750	2,375	Certa	24.799.152.000	0	184	18/19a : 99.31 1.50 mld (18/04/11)
01/08/2023	4,750	2,375	Certa	24.799.152.000	24.799.152.000	181	20/21a : 92.95 1.236.6 mld (18/07/11)
							22/23a : 93.79 918 mld (16/04/12)
							24/25a : 91.50 383,700 mld (17/07/12)
							26/27a : 99.94 816,082 mld (16/11/12)