

BTP 01/09/09-40 5.00% / IT0004532559

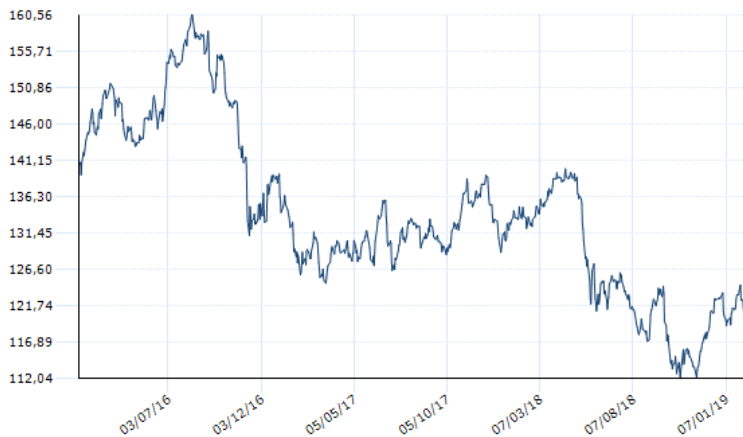
Grado di rischio calcolato

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
121,3 EUR	Republic of Italy	01/09/2040	2,500%	3,601%	3,039%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	121,3
Rendimento lordo	3,60138
Rendimento netto	3,03873
Cedola in corso	2,50000
Rateo lordo	2,30663
Rateo netto	2,01830
Vita residua	21,55890
Duration modificata	13,49390
Convessità	250,30478
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	22.152.355.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/09/2009
Prezzo emissione	98,1860
Decorrenza prima cedola regolare	01/09/2009
Tasso annuale	5,0000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/09/2040
Data estinzione	01/09/2040
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	101,2100	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	120,8500	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	121,2800	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	120,0060	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	120,0900	EUR
MOT	13/02/2019	121,3000	EUR
Euro MTS	13/02/2019	121,1500	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	121,1200	EUR
Euro TLX	13/02/2019	121,4200	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	121,1100	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/03/2019	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	181	1a : 98.186 6.000 mld (16/09/09)
01/09/2019	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	184	2/3a : 101.25 1.500 mld (16/10/09)
01/03/2020	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	182	4/5a : 102.42 3.580 mld (15/01/10)
01/09/2020	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	184	6/7a : 103.43 1.500 mld (16/03/10)
01/03/2021	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	181	8/9a : 99.66 1.727.662 mld (16/07/10)
01/09/2021	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	184	10/11a : 104.06 2.000 mld (15/09/10)
01/03/2022	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	181	12/13a : 93.58 1.676,100 mld (16/02/11)
01/09/2022	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	184	14/15a : 94.75 1.750 mld (17/05/11)
01/03/2023	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	181	16/17a : 99.93 887,500 mld (15/02/13)
01/09/2023	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	184	18/19a : 141.61 447,100 mld (16/11/15)
01/03/2024	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	182	20/21a : 133.28 604,750 mld (15/11/16)
01/09/2024	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	184	
01/03/2025	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	181	
01/09/2025	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	184	
01/03/2026	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	181	
01/09/2026	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	184	
01/03/2027	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	181	
01/09/2027	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	184	
01/03/2028	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	0	182	
01/09/2040	5,000	2,500	Certa	22.152.355.000	22.152.355.000	184	