

BTP 01/03/10-09/20 4.00% / IT0004594930

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
105,42 EUR	Republic of Italy	01/09/2020	2,000%	0,457%	-0,024%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	105,424
Rendimento lordo	0,45686
Rendimento netto	-0,02413
Cedola in corso	2,00000
Rateo lordo	1,84530
Rateo netto	1,61464
Vita residua	1,54521
Duration modificata	1,48244
Convessità	3,73522
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	24.922.124.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/03/2010
Prezzo emissione	100,7000
Decorrenza prima cedola regolare	01/03/2010
Tasso annuale	4,0000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/09/2020
Data estinzione	01/09/2020
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	105,2600	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	105,3800	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	105,3710	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	105,2600	EUR
MOT	13/02/2019	105,4240	EUR
Euro MTS	13/02/2019	105,4200	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	105,4270	EUR
Euro TLX	13/02/2019	105,4000	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	105,3686	EUR

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	4,000	2,000	Certa	24.922.124.000	0	181
01/09/2019	4,000	2,000	Certa	24.922.124.000	0	184
01/03/2020	4,000	2,000	Certa	24.922.124.000	0	182
01/09/2020	4,000	2,000	Certa	24.922.124.000	24.922.124.000	184

Annotazioni

1a : 100.70 5.000 mld (01/04/10).
 /2a : 100.70 1.250 mld (01/04/10).
 3/4a : 99.62 3.50 mld (03/05/10).
 5/6a : 99.75 3.877 mld (01/06/10).
 7/8a : 99.56 3.50 mld (01/07/10).
 9/10a : 100.96 3.50 mld (02/08/10).
 11/12a : 90.20 1.192 mld (15/09/11).
 13/14a : 79.76 1.498,500 mld (01/12/11).