

BTP 01/09/10-03/21 3.75% / IT0004634132

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
106,16 EUR	Republic of Italy	01/03/2021	1,875%	0,702%	0,248%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	106,16
Rendimento lordo	0,70167
Rendimento netto	0,24797
Cedola in corso	1,87500
Rateo lordo	1,72997
Rateo netto	1,51373
Vita residua	2,04110
Duration modificata	1,94105
Convessità	5,81585
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	24.268.782.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/09/2010
Prezzo emissione	99,8300
Decorrenza prima cedola regolare	01/09/2010
Tasso annuale	3,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/03/2021
Data estinzione	01/03/2021
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	106,0600	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	106,1800	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	106,1290	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	105,9600	EUR
MOT	13/02/2019	106,1600	EUR
Euro MTS	13/02/2019	106,1500	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	106,1780	EUR
Euro TLX	13/02/2019	106,1850	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	106,0824	EUR

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/03/2019	3,750	1,875	Certa	24.268.782.000	0	181	1a : 99.83 5.00 mld (30/08/10).
01/09/2019	3,750	1,875	Certa	24.268.782.000	0	184	/2a : 99.83 1.250 mld (30/08/10).
01/03/2020	3,750	1,875	Certa	24.268.782.000	0	182	3/4a : 99.00 3.00 mld (01/10/10).
01/09/2020	3,750	1,875	Certa	24.268.782.000	0	184	5/6a : 99.12 3.25 mld (01/11/10).
01/03/2021	3,750	1,875	Certa	24.268.782.000	24.268.782.000	181	7/8a : 94.79 2.998,040 mld (01/12/10).
							9/10a : 92.02 3.000 mld (03/01/11).
							11/12a : 92.66 3.250 mld (01/02/11).
							13/14a : 86.60 1.155,22 mld (01/02/12).