

BTP 01/09/10-03/26 4.50% / IT0004644735

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
114,21 EUR	Republic of Italy	01/03/2026	2,250%	2,312%	1,786%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	114,21
Rendimento lordo	2,31191
Rendimento netto	1,78622
Cedola in corso	2,25000
Rateo lordo	2,07597
Rateo netto	1,81647
Vita residua	7,04384
Duration modificata	5,94216
Convessità	44,75268
Cedola successiva	2,25000
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	21.999.898.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/09/2010
Prezzo emissione	100,0700
Decorrenza prima cedola regolare	01/09/2010
Tasso annuale	4,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/03/2026
Data estinzione	01/03/2026
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	113,9900	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	114,1700	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	114,0980	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	113,4900	EUR
MOT	13/02/2019	114,2100	EUR
Euro MTS	13/02/2019	114,0000	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	114,1550	EUR
Euro TLX	13/02/2019	114,2100	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	114,2100	EUR

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/03/2019	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	181	1a : 100.07 6.00 mld (29/09/10).
01/09/2019	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	184	/2a : 100.07 0.00 mld (29/09/10).
01/03/2020	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	182	3/4a : 97.30 2.25 mld (16/11/10).
01/09/2020	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	184	5a : 94.75 3.00 mld (17/01/11).
01/03/2021	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	181	6a : 92.05 1.984 mld (15/03/11).
01/09/2021	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	184	8/9a : 87.17 1.715,600 mld (18/07/11).
01/03/2022	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	181	10/11a : 92.81 1.500 mld (17/09/12).
01/09/2022	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	184	12/13a : 98.04 729,100 mld (17/12/12).
01/03/2023	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	181	14/15a : 99.95 862,500 mld (15/02/13).
01/09/2023	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	184	
01/03/2024	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	182	
01/09/2024	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	184	
01/03/2025	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	181	
01/09/2025	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	0	184	
01/03/2026	4,500	2,250	Certa	21.999.898.000	21.999.898.000	181	