

BTP 01/03/11-09/21 4.75% / IT0004695075
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
109,35 EUR	Republic of Italy	01/09/2021	2,375%	1,010%	0,444%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	109,35
Rendimento lordo	1,00996
Rendimento netto	0,44445
Cedola in corso	2,37500
Rateo lordo	2,19130
Rateo netto	1,91739
Vita residua	2,54521
Duration modificata	2,36252
Convessità	8,18209
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	24.986.368.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regolar
Data emissione	01/03/2011
Prezzo emissione	99,7300
Decorrenza prima cedola regolare	01/03/2011
Tasso annuale	4,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/09/2021
Data estinzione	01/09/2021
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	109,2100	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	109,3400	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	109,2760	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	109,0500	EUR
MOT	13/02/2019	109,3500	EUR
Euro MTS	13/02/2019	109,3500	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	109,3390	EUR
Euro TLX	13/02/2019	109,3730	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	109,2700	EUR

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/03/2019	4,750	2,375	Certa	24.986.368.000	0	181	1a : 99.73 5.00 mld (01/03/11).
01/09/2019	4,750	2,375	Certa	24.986.368.000	0	184	/2a : 99.73 1.148.937 mld (01/03/11).
01/03/2020	4,750	2,375	Certa	24.986.368.000	0	182	3/4a : 100.08 3.25 mld (01/04/11).
01/09/2020	4,750	2,375	Certa	24.986.368.000	0	184	5/6a : 99.71 3.354.2 mld (02/05/11).
01/03/2021	4,750	2,375	Certa	24.986.368.000	0	181	7/8a : 100.58 2.950,947 mld (01/06/11).
01/09/2021	4,750	2,375	Certa	24.986.368.000	24.986.368.000	184	9/10a : 98.96 3.00 mld (01/07/11).
							11/12a : 92.85 2.696,200 mld (01/08/11).
							13/14a : 92.95 1.158 mld (17/10/11).