

BTP 01/09/11-03/22 5.00% / IT0004759673

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
111,19 EUR	Republic of Italy	01/03/2022	2,500%	1,239%	0,637%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	111,19
Rendimento lordo	1,23894
Rendimento netto	0,63715
Cedola in corso	2,50000
Rateo lordo	2,30663
Rateo netto	2,01830
Vita residua	3,04110
Duration modificata	2,77813
Convessità	10,89574
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	20.635.579.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regolar
Data emissione	01/09/2011
Prezzo emissione	98,7500
Decorrenza prima cedola regolare	01/09/2011
Tasso annuale	5,0000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/03/2022
Data estinzione	01/03/2022
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	111,0600	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	111,2100	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	111,1440	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	110,8600	EUR
MOT	13/02/2019	111,1900	EUR
Euro MTS	13/02/2019	111,2000	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	111,2090	EUR
Euro TLX	13/02/2019	111,2340	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	110,8930	EUR

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/03/2019	5,000	2,500	Certa	20.635.579.000	0	181	1a : 98.75 3.75 mld (01/09/11)
01/09/2019	5,000	2,500	Certa	20.635.579.000	0	184	/2a : 98.75 1.000 mld (01/09/11)
01/03/2020	5,000	2,500	Certa	20.635.579.000	0	182	3/4a : 93.99 2.472.582 mld (03/10/11)
01/09/2020	5,000	2,500	Certa	20.635.579.000	0	184	5/6a : 92.60 2.979.600 mld (01/11/11)
01/03/2021	5,000	2,500	Certa	20.635.579.000	0	181	7/8a : 82.81 2.50 mld (01/12/11)
01/09/2021	5,000	2,500	Certa	20.635.579.000	0	184	9/10a : 86.53 2.50 mld (02/01/12)
01/03/2022	5,000	2,500	Certa	20.635.579.000	20.635.579.000	181	11/12a : 92.60 2.00 mld (01/02/12)
							13/14a : 95.64 650,797 mld (16/05/12)
							15/16a : 94.60 600,100 mld (17/07/12)