

BTP 01/03/12-09/22 5.50% / IT0004801541

## 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
114,06 EUR	Republic of Italy	01/09/2022	2,750%	1,415%	0,777%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	114,06
Rendimento lordo	1,41469
Rendimento netto	0,77663
Cedola in corso	2,75000
Rateo lordo	2,53729
Rateo netto	2,22013
Vita residua	3,54521
Duration modificata	3,17450
Convessità	13,90039
Cedola successiva	2,75000
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	19.586.032.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/03/2012
Prezzo emissione	100,5800
Decorrenza prima cedola regolare	01/03/2012
Tasso annuale	5,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/09/2022
Data estinzione	01/09/2022
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	113,9100	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	114,0700	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	113,9800	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	113,7100	EUR
MOT	13/02/2019	114,0600	EUR
Euro MTS	13/02/2019	114,0300	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	114,0410	EUR
Euro TLX	13/02/2019	114,0980	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	114,1170	EUR

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	5,500	2,750	Certa	19.586.032.000	0	181
01/09/2019	5,500	2,750	Certa	19.586.032.000	0	184
01/03/2020	5,500	2,750	Certa	19.586.032.000	0	182
01/09/2020	5,500	2,750	Certa	19.586.032.000	0	184
01/03/2021	5,500	2,750	Certa	19.586.032.000	0	181
01/09/2021	5,500	2,750	Certa	19.586.032.000	0	184
01/03/2022	5,500	2,750	Certa	19.586.032.000	0	181
01/09/2022	5,500	2,750	Certa	19.586.032.000	19.586.032.000	184

## Annotazioni

Risultati asta:
1a 100.58 3.750 mld 01/03/12
/2a 100.58 937.000 mld 01/03/12
Risultati riapertura:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 102.62 3.250 mld 02/04/12
5/6a 97.98 2.500 mld 02/05/12
7/8a 96.60 2.340 mld 01/06/12
9/10a 95.51 2.922,500 mld 02/07/12
11/12a 97.18 2.484,750 mld 01/08/12