

BTP 01/05/12-11/22 5.50% / IT0004848831

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
114,35 EUR	Republic of Italy	01/11/2022	2,750%	1,508%	0,852%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	114,35
Rendimento lordo	1,50827
Rendimento netto	0,85224
Cedola in corso	2,75000
Rateo lordo	1,61050
Rateo netto	1,40919
Vita residua	3,71233
Duration modificata	3,33594
Convessità	15,10665
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	21.378.388.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/05/2012
Prezzo emissione	98,2000
Decorrenza prima cedola regolare	01/05/2012
Tasso annuale	5,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/11/2022
Data estinzione	01/11/2022
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	114,1400	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	114,3000	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	114,2460	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	113,9300	EUR
MOT	13/02/2019	114,3500	EUR
Euro MTS	13/02/2019	114,3400	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	114,3070	EUR
Euro TLX	13/02/2019	114,3570	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	114,2427	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/05/2019	5,500	2,750	Certa	21.378.388.000	0	181	Risultati asta:
01/11/2019	5,500	2,750	Certa	21.378.388.000	0	184	1a 98.20 4.000 mld 03/09/12
01/05/2020	5,500	2,750	Certa	21.378.388.000	0	182	/2a 98.20 516.560 mld 03/09/12
01/11/2020	5,500	2,750	Certa	21.378.388.000	0	184	Risultati riaperture:
01/05/2021	5,500	2,750	Certa	21.378.388.000	0	181	Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
01/11/2021	5,500	2,750	Certa	21.378.388.000	0	184	3/4a 102.50 2.927,035 mld 01/10/12
01/05/2022	5,500	2,750	Certa	21.378.388.000	0	181	7/8a 107.70 2.982,300 mld 03/12/12
01/11/2022	5,500	2,750	Certa	21.378.388.000	21.378.388.000	184	9/10a 108.43 3.000 mld 02/01/13
							11/12a 110.90 3.500 mld 01/02/13