

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
117,31 EUR	Republic of Italy	01/09/2028	2,375%	2,696%	2,149%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	117,31
Rendimento lordo	2,69558
Rendimento netto	2,14890
Cedola in corso	2,37500
Rateo lordo	2,19130
Rateo netto	1,91739
Vita residua	9,55068
Duration modificata	7,59949
Convessità	73,26117
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	23.914.154.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	22/01/2013
Prezzo emissione	100,0170
Decorrenza prima cedola regolare	01/03/2013
Data Prorata	22/01/2013
Tasso annuale	4,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/09/2028
Data estinzione	01/09/2028
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	115,8000	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	117,0400	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	117,3500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	117,2280	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	116,7400	EUR
MOT	13/02/2019	117,3100	EUR
Euro MTS	13/02/2019	117,2600	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	117,3020	EUR
Euro TLX	13/02/2019	117,4000	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	117,0011	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/03/2019	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	181	Risultati asta:
01/09/2019	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	184	1a 100.017 6.000 mld 22/01/2013
01/03/2020	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	182	Risultati riapertura:
01/09/2020	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	184	Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
01/03/2021	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	181	2/3a 98.99 2.000.500 mld 15/03/2013
01/09/2021	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	184	4a 101.33 1.668.573 mld 15/04/2013
01/03/2022	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	181	5/6a 101.40 1.500 mld 17/06/2013
01/09/2022	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	184	8/9a 99.21 1.500 mld 16/09/2013
01/03/2023	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	181	10/11a 102.29 1.250 mld 15/10/2013
01/09/2023	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	184	12/13a 105.78 1.694.901 mld 14/01/2014
01/03/2024	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	182	14/15a 110.31 1.500 mld 17/03/2014
01/09/2024	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	184	
01/03/2025	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	181	
01/09/2025	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	184	
01/03/2026	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	181	
01/09/2026	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	184	
01/03/2027	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	181	
01/09/2027	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	184	
01/03/2028	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	0	182	
01/09/2028	4,750	2,375	Certa	23.914.154.000	23.914.154.000	184	