

BTP 01/03/13-01/09/44 4.75% / IT0004923998

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
118,56 EUR	Republic of Italy	01/09/2044	2,375%	3,658%	3,115%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	118,56
Rendimento lordo	3,65834
Rendimento netto	3,11519
Cedola in corso	2,37500
Rateo lordo	2,19130
Rateo netto	1,91739
Vita residua	25,56164
Duration modificata	15,12859
Convessità	321,97269
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	17.119.363.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/03/2013
Prezzo emissione	97,2210
Decorrenza prima cedola regolare	01/03/2013
Tasso annuale	4,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/09/2044
Data estinzione	01/09/2044
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	118,1600	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	118,1400	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	118,5800	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	117,2770	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	117,3500	EUR
MOT	13/02/2019	118,5600	EUR
Euro MTS	13/02/2019	116,1700	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	118,4600	EUR
Euro TLX	13/02/2019	118,7300	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	118,6650	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	17.119.363.000	0	181	Risultati asta:
01/09/2019	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	184	1a 97.221 6.000 mld 22/05/2013
01/03/2020	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	182	Risultati riapertura:
01/09/2020	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	184	Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
01/03/2021	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	181	2a/3a 94.22 1.460.752 mld 15/07/2013
01/09/2021	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	184	4a/5a 97.17 1.467.711 mld 15/11/2013
01/03/2022	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	181	6a/7a 103.47 1.500 mld 17/02/2014
01/09/2022	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	184	8a/9a 108.97 1.224.800 mld 15/04/2014
01/03/2023	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	181	10a/11a 112.98 1.000.000 mld 16/06/2014
01/09/2023	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	184	12a/13a 120.30 1.250.000 mld 15/10/2014
01/03/2024	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	182	14a/15a 147.41 741.500 mld 15/06/2016
01/09/2024	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	184	16a/17a 124.84 1.249.250 mld 15/05/2017
01/03/2025	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	181	
01/09/2025	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	184	
01/03/2026	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	181	
01/09/2026	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	184	
01/03/2027	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	181	
01/09/2027	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	184	
01/03/2028	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	0	182	
01/09/2044	4,750	2,375	Certa	17.119.363.000	17.119.363.000	184	