

BTP 01/08/13-01/03/24 4.50% / IT0004953417

## 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
112,42 EUR	Republic of Italy	01/03/2024	2,250%	1,910%	1,381%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	112,42
Rendimento lordo	1,91004
Rendimento netto	1,38067
Cedola in corso	2,25000
Rateo lordo	2,07597
Rateo netto	1,81647
Vita residua	5,04384
Duration modificata	4,43401
Convessità	25,53034
Cedola successiva	2,25000
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	23.264.571.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	01/08/2013
Prezzo emissione	100,7700
Decorrenza prima cedola regolare	01/09/2013
Data Prorata	01/08/2013
Tasso annuale	4,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/03/2024
Data estinzione	01/03/2024
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	124,0000	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	112,2790	EUR
MOT	13/02/2019	112,4200	EUR
Euro MTS	13/02/2019	111,9800	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	112,3380	EUR
Euro TLX	13/02/2019	112,4300	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	112,3900	EUR

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	4,500	2,250	Certa	23.264.571.000	0	181
01/09/2019	4,500	2,250	Certa	23.264.571.000	0	184
01/03/2020	4,500	2,250	Certa	23.264.571.000	0	182
01/09/2020	4,500	2,250	Certa	23.264.571.000	0	184
01/03/2021	4,500	2,250	Certa	23.264.571.000	0	181
01/09/2021	4,500	2,250	Certa	23.264.571.000	0	184
01/03/2022	4,500	2,250	Certa	23.264.571.000	0	181
01/09/2022	4,500	2,250	Certa	23.264.571.000	0	184
01/03/2023	4,500	2,250	Certa	23.264.571.000	0	181
01/09/2023	4,500	2,250	Certa	23.264.571.000	0	184
01/03/2024	4,500	2,250	Certa	23.264.571.000	23.264.571.000	182

## Annotazioni

Risultati asta:
1a 100.77 3.750 mld 01/08/2013
2a 100.77 1.113.971 mld 01/08/2013
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 100.70 2.500 mld 02/09/2013
5/6a 100.39 3.000 mld 01/10/2013
7/8a 103.61 3.000 mld 01/11/2013
9/10a 104.45 2.500 mld 02/12/2013
11/12a 103.53 2.500 mld 02/01/2014
13/14a 106.00 3.000 mld 03/02/2014