

BTP 16/10/13-01/05/21 3.75% / IT0004966401

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
106,44 EUR	Republic of Italy	01/05/2021	1,875%	0,799%	0,349%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	106,44
Rendimento lordo	0,79933
Rendimento netto	0,34878
Cedola in corso	1,87500
Rateo lordo	1,09807
Rateo netto	0,96081
Vita residua	2,20822
Duration modificata	2,11005
Convessità	6,66683
Cedola successiva	1,87500
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	17.511.467.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	16/10/2013
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	01/11/2013
Data Prorata	16/10/2013
Tasso annuale	3,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/05/2021
Data estinzione	01/05/2021
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	113,0000	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	106,3100	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	106,4300	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	106,3750	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	106,1900	EUR
MOT	13/02/2019	106,4400	EUR
Euro MTS	13/02/2019	106,4600	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	106,4300	EUR
Euro TLX	13/02/2019	106,4460	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	106,4500	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
01/05/2019	3,750	1,875	Certa	17.511.467.000	0	181	Risultati asta: 1a 100.138 5.000 mld 16/10/2013
01/11/2019	3,750	1,875	Certa	17.511.467.000	0	184	
01/05/2020	3,750	1,875	Certa	17.511.467.000	0	182	Risultati riapertura: Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
01/11/2020	3,750	1,875	Certa	17.511.467.000	0	184	2/3a 103.89 2.500 mld 15/01/2014
01/05/2021	3,750	1,875	Certa	17.511.467.000	17.511.467.000	181	4a/5a 104.81 2.500 mld 17/02/2014 6a/7a 106.79 2.000 mld 17/03/2014 8a/9a 108.53 2.500 mld 15/04/2014 10a/11a 109.44 2.250 mld 15/05/2014