

BTP 01/03/14-01/09/24 3.75% / IT0005001547

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
108,93 EUR	Republic of Italy	01/09/2024	1,875%	2,043%	1,593%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	108,93
Rendimento lordo	2,04269
Rendimento netto	1,59330
Cedola in corso	1,87500
Rateo lordo	1,72997
Rateo netto	1,51373
Vita residua	5,54795
Duration modificata	4,90874
Convessità	30,64058
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	19.826.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regolar
Data emissione	01/03/2014
Prezzo emissione	103,1100
Decorrenza prima cedola regolare	01/03/2014
Tasso annuale	3,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/09/2024
Data estinzione	01/09/2024
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	108,7300	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	108,9200	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	108,8570	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	108,4300	EUR
MOT	13/02/2019	108,9300	EUR
Euro MTS	13/02/2019	108,4300	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	108,9210	EUR
Euro TLX	13/02/2019	108,9600	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	109,0000	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	0	181
01/09/2019	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	0	184
01/03/2020	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	0	182
01/09/2020	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	0	184
01/03/2021	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	0	181
01/09/2021	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	0	184
01/03/2022	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	0	181
01/09/2022	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	0	184
01/03/2023	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	0	181
01/09/2023	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	0	184
01/03/2024	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	0	182
01/09/2024	3,750	1,875	Certa	19.826.000.000	19.826.000.000	184

Annotazioni

Risultati asta:
1a 103.11 4.000 mld 03/03/2014
2a 103.11 250.000 mld 03/03/2014
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 104.23 4.000 mld 01/04/2014
5/6a 104.85 3.000 mld 02/05/2014
7/8a 106.70 3.000 mld 02/06/2014
9/10a 108.42 2.500 mld 01/07/2014
11/12a 110.29 2.500 mld 01/08/2014