

CCTeu 15/11/13-19 (1.20 AT) / IT0005009839

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
100,64 EUR	Republic of Italy	15/11/2019	0,474%	0,118%	-0,001%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,637
Rendimento lordo	0,11811
Rendimento netto	-0,00106
Cedola in corso	0,47400
Rateo lordo	0,24093
Rateo netto	0,21081
Vita residua	0,74795
Duration modificata	0,25869
Convessità	0,32561
Cedola successiva	0,49400
Mercato di riferimento	MOT

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Italy
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	12.429.855.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/11/2013
Prezzo emissione	101,1400
Decorrenza prima cedola regolare	15/11/2013
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/11/2019
Data estinzione	15/11/2019
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
MOT	13/02/2019	100,6370	EUR
Euro MTS	13/02/2019	100,6420	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,6310	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,6310	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,6236	EUR

Formula di indicizzazione

$$TV = (\text{Euribor } 6m + 1.20) \times \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg)}$$

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/05/2019	0,943	0,474	Certa	12.429.855.000	0	181
15/11/2019	0,000	0,494	Prevista	12.429.855.000	12.429.855.000	184

Annotazioni

 Risultati asta:
 1a 101.14 3.250 mld 01/04/2014
 / 2a 101.14 500 mld 01/04/2014

Risultati riapertura:

 Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
 3/ 4a 101.00 2.280.396 mld 02/05/2014
 5/ 6a 101.38 1.750 mld 02/06/2014
 7/ 8a 102.10 1.448.849 mld 01/07/2014
 9/10a 102.72 1.500 mld 01/08/2014
 10/11a 102.45 1.500 mld 01/09/2014

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/11/2013	15/11/2019	EURIBOR6M	1,000	1,200