

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
105,43 EUR	Republic of Italy	01/03/2030	1,750%	2,940%	2,507%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	105,43
Rendimento lordo	2,93974
Rendimento netto	2,50705
Cedola in corso	1,75000
Rateo lordo	1,61464
Rateo netto	1,41281
Vita residua	11,04658
Duration modificata	8,91264
Convessità	98,39201
Cedola successiva	1,75000
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	23.156.449.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/03/2014
Prezzo emissione	99,4710
Decorrenza prima cedola regolare	01/03/2014
Tasso annuale	3,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/03/2030
Data estinzione	01/03/2030
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	105,0800	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	105,3500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	105,2550	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	104,7500	EUR
MOT	13/02/2019	105,4300	EUR
Euro MTS	13/02/2019	105,4300	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	105,3350	EUR
Euro TLX	13/02/2019	105,4500	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	105,4600	EUR

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	181
01/09/2019	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	184
01/03/2020	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	182
01/09/2020	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	184
01/03/2021	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	181
01/09/2021	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	184
01/03/2022	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	181
01/09/2022	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	184
01/03/2023	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	181
01/09/2023	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	184
01/03/2024	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	182
01/09/2024	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	184
01/03/2025	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	181
01/09/2025	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	184
01/03/2026	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	181
01/09/2026	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	184
01/03/2027	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	181
01/09/2027	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	184
01/03/2028	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	0	182
01/03/2030	3,500	1,750	Certa	23.156.449.000	23.156.449.000	181

Annotazioni

Risultati asta:
1/ 99.471 7.000 mld 21/05/2014
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
2/3a 101.05 2.000 mld 15/07/2014
4/5a 106.00 2.000 mld 15/09/2014
6/7a 106.76 1.500 mld 17/11/2014
8/9a 113.28 1.500 mld 15/01/2015
10/11a 118.16 1.500 mld 16/02/2015
12/13a 124.55 1.500 mld 15/04/2015
14/15a 117.36 1.000 mld 15/02/2016
16/17a 122.15 705.949 mld 15/04/2016
18/19a 119.47 1.000 mld 16/05/2016
20/21a 110.78 1.000 mld 18/04/2017