

BTP 15/06/14-15/12/21 2.15% / IT0005028003

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
103,02 EUR	Republic of Italy	15/12/2021	1,075%	1,065%	0,800%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	103,02
Rendimento lordo	1,06512
Rendimento netto	0,80026
Cedola in corso	1,07500
Rateo lordo	0,36621
Rateo netto	0,32043
Vita residua	2,83288
Duration modificata	2,72666
Convessità	10,26554
Cedola successiva	1,07500
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	17.657.877.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regolar
Data emissione	15/06/2014
Prezzo emissione	100,2700
Decorrenza prima cedola regolare	15/06/2014
Tasso annuale	2,1500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/12/2021
Data estinzione	15/12/2021
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	102,8700	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	103,0000	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	102,9470	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	102,6900	EUR
MOT	13/02/2019	103,0200	EUR
Euro MTS	13/02/2019	103,0300	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	102,9980	EUR
Euro TLX	13/02/2019	103,0230	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	103,0003	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/06/2019	2,150	1,075	Certa	17.657.877.000	0	182
15/12/2019	2,150	1,075	Certa	17.657.877.000	0	183
15/06/2020	2,150	1,075	Certa	17.657.877.000	0	183
15/12/2020	2,150	1,075	Certa	17.657.877.000	0	183
15/06/2021	2,150	1,075	Certa	17.657.877.000	0	182
15/12/2021	2,150	1,075	Certa	17.657.877.000	17.657.877.000	183

Annotazioni

Risultati asta:
1a 100.27 4.000 mld 15/06/2014
2a 100.27 936.228 mld 15/06/2014
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 99.93 2.500 mld 15/07/2014
5/6a 103.01 2.500 mld 15/09/2014
7/8a 102.99 2.000 mld 15/10/2014
9/10a 102.75 2.000 mld 17/11/2014