

BTP 01/09/14-01/12/24 2.50% / IT0005045270

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
102,5 EUR	Republic of Italy	01/12/2024	1,250%	2,047%	1,737%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	102,5
Rendimento lordo	2,04713
Rendimento netto	1,73659
Cedola in corso	1,25000
Rateo lordo	0,52198
Rateo netto	0,45673
Vita residua	5,79726
Duration modificata	5,30578
Convessità	34,64244
Cedola successiva	1,25000
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	20.383.767.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	01/09/2014
Prezzo emissione	101,1400
Decorrenza prima cedola regolare	01/12/2014
Data Prorata	01/09/2014
Tasso annuale	2,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/12/2024
Data estinzione	01/12/2024
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	102,3400	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	102,5100	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	102,4560	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	102,0200	EUR
MOT	13/02/2019	102,5000	EUR
Euro MTS	13/02/2019	102,0400	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	102,5210	EUR
Euro TLX	13/02/2019	102,5800	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	102,2885	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/06/2019	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	0	182
01/12/2019	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	0	183
01/06/2020	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	0	183
01/12/2020	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	0	182
01/06/2021	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	0	182
01/12/2021	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	0	183
01/06/2022	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	0	182
01/12/2022	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	0	183
01/06/2023	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	0	182
01/12/2023	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	0	183
01/06/2024	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	0	183
01/12/2024	2,500	1,250	Certa	20.383.767.000	20.383.767.000	183

Annotazioni

Risultati asta:
1a 101.14 4.000 mld 01/09/2014
2a 101.14 500 mld 01/09/2014
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 100.59 3.000 mld 01/10/2014
5/6a 100.66 2.750 mld 03/11/2014
7/8a 103.87 2.000 mld 01/12/2014
9/10a 105.58 2.995.767 mld 02/01/2015
11/12a 108.04 3.000 mld 02/02/2015