

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
100,75 EUR	Republic of Italy	01/12/2019	0,525%	0,106%	-0,022%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,745
Rendimento lordo	0,10580
Rendimento netto	-0,02230
Cedola in corso	0,52500
Rateo lordo	0,21923
Rateo netto	0,19183
Vita residua	0,79178
Duration modificata	0,79110
Convessità	1,41738
Cedola successiva	0,52500
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	15.470.969.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regolar
Data emissione	01/12/2014
Prezzo emissione	100,5300
Decorrenza prima cedola regolare	01/12/2014
Tasso annuale	1,0500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/12/2019
Data estinzione	01/12/2019
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	100,6300	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,7400	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,7010	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	100,6400	EUR
MOT	13/02/2019	100,7450	EUR
Euro MTS	13/02/2019	100,7670	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,7500	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,7780	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,7687	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/06/2019	1,050	0,525	Certa	15.470.969.000	0	182
01/12/2019	1,050	0,525	Certa	15.470.969.000	15.470.969.000	183

Annotazioni

 Risultati asta:
 1a 100.53 3.500 mld 01/12/2014
 2a 100.53 50.000 mld 01/12/2014

Risultati riaperture:

 Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
 3/4a 100.34 2.845.969 mld 02/01/2015
 5/6a 100.74 3.000 mld 02/02/2015
 7/8a 102.31 2.500 mld 02/03/2015
 9/10a 102.28 2.000 mld 01/04/2015