

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
100,35 EUR	Republic of Italy	15/04/2022	0,675%	1,235%	1,067%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,35
Rendimento lordo	1,23532
Rendimento netto	1,06668
Cedola in corso	0,67500
Rateo lordo	0,45618
Rateo netto	0,39916
Vita residua	3,16438
Duration modificata	3,06755
Convessità	12,58412
Cedola successiva	0,67500
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	17.784.500.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	16/02/2015
Prezzo emissione	100,8000
Decorrenza prima cedola regolare	15/04/2015
Data Prorata	16/02/2015
Tasso annuale	1,3500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/04/2022
Data estinzione	15/04/2022
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	100,2000	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,3500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,2850	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	100,0100	EUR
MOT	13/02/2019	100,3500	EUR
Euro MTS	13/02/2019	99,6800	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,3380	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,3730	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,1864	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/04/2019	1,350	0,675	Certa	17.784.500.000	0	182
15/10/2019	1,350	0,675	Certa	17.784.500.000	0	183
15/04/2020	1,350	0,675	Certa	17.784.500.000	0	183
15/10/2020	1,350	0,675	Certa	17.784.500.000	0	183
15/04/2021	1,350	0,675	Certa	17.784.500.000	0	183
15/10/2021	1,350	0,675	Certa	17.784.500.000	0	183
15/04/2022	1,350	0,675	Certa	17.784.500.000	17.784.500.000	182

Annotazioni

Risultati asta:
1a 100.80 4.000 mld 16/02/2015
/2a 100.80 1.200 mld 16/02/2015
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 104.40 3.000 mld 16/03/2015
5/6a 103.09 2.500 mld 15/04/2015
7/8a 100.29 2.500 mld 15/05/2015
9/10a 97.43 2.000 mld 15/06/2015
11/12a 98.43 1.984.500 mld 15/07/2015