

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
86,21 EUR	Republic of Italy	01/03/2032	0,825%	2,949%	2,719%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	86,21
Rendimento lordo	2,94895
Rendimento netto	2,71890
Cedola in corso	0,82500
Rateo lordo	0,76119
Rateo netto	0,66604
Vita residua	13,04932
Duration modificata	11,23834
Convessità	147,87432
Cedola successiva	0,82500
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	21.906.727.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/03/2015
Prezzo emissione	99,5010
Decorrenza prima cedola regolare	01/03/2015
Tasso annuale	1,6500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/03/2032
Data estinzione	01/03/2032
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	85,8800	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	86,1100	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	85,9730	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	85,4700	EUR
MOT	13/02/2019	86,2100	EUR
Euro MTS	13/02/2019	86,2300	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	86,0400	EUR
Euro TLX	13/02/2019	86,1800	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	85,9646	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	181
01/09/2019	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	184
01/03/2020	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	182
01/09/2020	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	184
01/03/2021	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	181
01/09/2021	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	184
01/03/2022	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	181
01/09/2022	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	184
01/03/2023	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	181
01/09/2023	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	184
01/03/2024	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	182
01/09/2024	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	184
01/03/2025	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	181
01/09/2025	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	184
01/03/2026	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	181
01/09/2026	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	184
01/03/2027	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	181
01/09/2027	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	184
01/03/2028	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	0	182
01/03/2032	1,650	0,825	Certa	21.906.727.000	21.906.727.000	182

Annotazioni

Risultati asta:
1a 99.501 8.000 mld 24/03/2015
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
2a/3a 90.96 749.900 mld 15/05/2015
4a/5a 85.37 676.898 mld 15/06/2015
6a/7a 87.09 1.500.000 mld 15/07/2015
10a/11a 94.95 1.750.000 mld 15/01/2016
12a/13a 97.54 1.500.000 mld 15/03/2016
14a/15a 95.58 1.500.000 mld 16/05/2016
16a/17a 101.25 1.250.000 mld 15/07/2016
18a/19a 98.50 2.000 mld 17/10/2016