

CCTeu 15/12/14-06/22 (0.55 AT) / IT0005104473

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
97,14 EUR	Republic of Italy	15/06/2022	0,157%	1,203%	1,162%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,14
Rendimento lordo	1,20288
Rendimento netto	1,16184
Cedola in corso	0,15700
Rateo lordo	0,05348
Rateo netto	0,04680
Vita residua	3,33151
Duration modificata	0,30374
Convessità	0,39600
Cedola successiva	0,16100
Mercato di riferimento	MOT

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Italy
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	15.690.945.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/12/2014
Prezzo emissione	100,1300
Decorrenza prima cedola regolare	15/12/2014
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/06/2022
Data estinzione	15/06/2022
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
MOT	13/02/2019	97,1400 EUR
Euro MTS	13/02/2019	96,2600 EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	97,1380 EUR
Euro TLX	13/02/2019	97,1790 EUR
Hi-MTF	13/02/2019	97,1500 EUR

Formula di indicizzazione

 $TV = (\text{Euribor } 6m + 0,55) \times \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg)}$

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/06/2019	0,311	0,157	Certa	15.690.945.000	0	182
15/12/2019	0,000	0,161	Prevista	15.690.945.000	0	183
15/06/2020	0,000	0,161	Prevista	15.690.945.000	0	183
15/12/2020	0,000	0,161	Prevista	15.690.945.000	0	183
15/06/2021	0,000	0,161	Prevista	15.690.945.000	0	182
15/12/2021	0,000	0,161	Prevista	15.690.945.000	0	183
15/06/2022	0,000	0,161	Prevista	15.690.945.000	15.690.945.000	182

Annotazioni

Risultati asta:
1a 100.13 3.000.000 mld 01/04/2015
2a 100.13 900.000 mld 01/04/2015
Risultati riapertura:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/ 4a 99.75 2.250.000 mld 04/05/2015
5/ 6a 99.62 2.000.000 mld 01/06/2015
7/ 8a 96.74 2.403.945 mld 02/07/2015
9/10a 99.49 1.750.000 mld 03/08/2015
11/12a 99.68 1.500.000 mld 01/09/2015
13/14a 98.49 1.000.000 mld 01/12/2016
95.614 713.000 mln 11/09/2018 riacquisto

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/12/2014	15/06/2022	EURIBOR6M	1,000	0,550