

BTPi 20/04/15-23 CUM 0.50% (FOI) / IT0005105835
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 |
| 97,42 EUR | Republic of Italy | 20/04/2023 | 0,250% | 2,842% | 2,771% |


Analisi

| | |
|----------------------------|------------|
| Data ultima quotazione | 13/02/2019 |
| Data valutazione | 13/02/2019 |
| Data valuta | 15/02/2019 |
| Prezzo | 97,42 |
| Rendimento lordo | 2,84203 |
| Rendimento netto | 2,77132 |
| Cedola in corso | 0,25000 |
| Rateo lordo | 0,16209 |
| Rateo netto | 0,14183 |
| Vita residua | 4,17808 |
| Duration modificata | 1,88154 |
| Convessità | 4,72293 |
| Cedola successiva | 0,25000 |
| Coefficiente di inflazione | 0,99421 |
| Mercato di riferimento | MOT |

Dati anagrafici principali

| | |
|-------------------|-------------------|
| Ente emittente | Republic of Italy |
| Tipo obbligazione | Inflation Linked |
| Tipo tasso | Tasso Variabile |
| Divisa | EUR |
| Convertibilità | Nessuno |

Caratteristiche principali

| | |
|----------------------------------|---------------|
| Nominale circolante | 9.392.014.117 |
| Nominale obbligazione | 1.000,00 |
| Taglio minimo | 1.000,00 |
| Corso | Secco |
| Sottoscrizione | Regular |
| Data emissione | 20/04/2015 |
| Prezzo emissione | 100,0000 |
| Decorrenza prima cedola regolare | 20/04/2015 |
| Frequenza cedola | 2 |
| Base rateo cedola | ACT/ACT |
| Subordinato | NO |

Rimborso

| | |
|-----------------------------|-----------------|
| Tipo ammortamento | Unica Soluzione |
| Data 1° rimborso | 20/04/2023 |
| Data estinzione | 20/04/2023 |
| Base rateo capitale | Lineare |
| Indicizzazione sul capitale | Si |
| Opzione call | no |
| Opzione put | no |
| Prezzo di rimborso | 100,400 |
| Regime fiscale | Tassato 12,5% |

Mercati di quotazione

| Mercato | Data | Valore | Valuta |
|-------------------|------------|---------|--------|
| Frankfurter Börse | 13/02/2019 | 97,1100 | EUR |
| Börse Düsseldorf | 13/02/2019 | 97,2600 | EUR |
| Bayerische Börse | 13/02/2019 | 97,3180 | EUR |
| Börse Berlin | 13/02/2019 | 97,0200 | EUR |
| MOT | 13/02/2019 | 97,4200 | EUR |
| Börse Stuttgart | 13/02/2019 | 97,3560 | EUR |
| Euro TLX | 13/02/2019 | 97,4250 | EUR |

Formula di indicizzazione

Buono del Tesoro Poliennale legato all'Inflazione Italiana (FOI ex tabacco) CUM Premio Fedelta'.
 CEDOLA= 0,25 * VN * Max (IRi/IR0 ; 1)
 RIV CAPITALE= VN * Max (IRi/IR0 - 1; 0)

Flusso cedolare

| Data flusso | Tasso annuo % | Val. cedola | Tipo cedola | Val. residuo | Val. ammortato | Giorni |
|-------------|---------------|-------------|-------------|---------------|----------------|--------|
| 20/04/2019 | 0,000 | 0,250 | Prevista | 9.392.014.117 | 0 | 182 |
| 20/10/2019 | 0,000 | 0,250 | Prevista | 9.392.014.117 | 0 | 183 |
| 20/04/2020 | 0,000 | 0,250 | Prevista | 9.392.014.117 | 0 | 183 |
| 20/10/2020 | 0,000 | 0,250 | Prevista | 9.392.014.117 | 0 | 183 |
| 20/04/2021 | 0,000 | 0,250 | Prevista | 9.392.014.117 | 0 | 182 |
| 20/10/2021 | 0,000 | 0,250 | Prevista | 9.392.014.117 | 0 | 183 |
| 20/04/2022 | 0,000 | 0,250 | Prevista | 9.392.014.117 | 0 | 182 |
| 20/10/2022 | 0,000 | 0,250 | Prevista | 9.392.014.117 | 0 | 183 |
| 20/04/2023 | 0,000 | 0,250 | Prevista | 9.392.014.117 | 9.392.014.117 | 182 |

Annotazioni

Dove:
 VN : Valore nominale dell'obbligazione
 IR0 : Inflazione di Riferimento del semestre (valore dell'indice alla data di pagamento della cedola immediatamente precedente oppure valore indice FOI massimo raggiunto nei semestri precedenti)
 Il numero indice usato come base per il calcolo dei coefficienti del primo semestre e' 106.69

Il Codice ISIN senza Premio Fedelta' e' : IT0005105843.

IRi : IRm-3 + (d-1)/D * (IRm-2 - IRm-3)

m : mese di riferimento

d : giorno di riferimento

D : n. giorni del mese m

Risultati asta:

1/2a 100.00

Indicizzazione cedole

| Da | A | Descrizione indice | Peso | Spread |
|------------|------------|-----------------------------|-------|--------|
| 20/04/2015 | 20/04/2023 | CPI Italia (FOI ex tabacco) | 1,000 | 0,000 |