

BTP 01/05/15-20 0.70% / IT0005107708

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
100,44 EUR	Republic of Italy	01/05/2020	0,350%	0,331%	0,244%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,442
Rendimento lordo	0,33050
Rendimento netto	0,24383
Cedola in corso	0,35000
Rateo lordo	0,20497
Rateo netto	0,17935
Vita residua	1,20822
Duration modificata	1,20719
Convessità	2,66488
Cedola successiva	0,35000
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	16.008.150.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/05/2015
Prezzo emissione	100,3300
Decorrenza prima cedola regolare	01/05/2015
Tasso annuale	0,7000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/05/2020
Data estinzione	01/05/2020
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	100,2900	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,4100	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,4240	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	100,3000	EUR
MOT	13/02/2019	100,4420	EUR
Euro MTS	13/02/2019	100,4580	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,4710	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,4850	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,4210	EUR

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/05/2019	0,700	0,350	Certa	16.008.150.000	0	181
01/11/2019	0,700	0,350	Certa	16.008.150.000	0	184
01/05/2020	0,700	0,350	Certa	16.008.150.000	16.008.150.000	182

Annotazioni

Risultati asta:	
1a	100.33 4.000 mld 04/05/2015
2a	100.33 68.500 mld 04/05/2015
Risultati riaperture:	
Tranche	Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a	99.27 2.434.400 mld 01/06/2015
5/6a	97.43 1.500 mld 02/07/2015
7/8a	99.67 1.908.333 mld 03/08/2015
9/10a	99.36 2.000 mld 01/09/2015
11/12a	99.96 2.000 mld 01/10/2015
13/14a	101.04 1.000 mld 15/02/2017