

BTP 01/09/15-01/12/25 2.00% / IT0005127086

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
98,69 EUR	Republic of Italy	01/12/2025	1,000%	2,219%	1,965%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,69
Rendimento lordo	2,21871
Rendimento netto	1,96454
Cedola in corso	1,00000
Rateo lordo	0,41758
Rateo netto	0,36538
Vita residua	6,79726
Duration modificata	6,22217
Convessità	46,52588
Cedola successiva	1,00000
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	18.813.796.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	01/09/2015
Prezzo emissione	100,5100
Decorrenza prima cedola regolare	01/12/2015
Data Prorata	01/09/2015
Tasso annuale	2,0000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/12/2025
Data estinzione	01/12/2025
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	98,4700	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	98,6500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	98,5730	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	98,1600	EUR
MOT	13/02/2019	98,6900	EUR
Euro MTS	13/02/2019	98,5700	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	98,6400	EUR
Euro TLX	13/02/2019	98,7000	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	98,6011	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/06/2019	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	182
01/12/2019	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	183
01/06/2020	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	183
01/12/2020	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	183
01/06/2021	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	182
01/12/2021	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	183
01/06/2022	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	182
01/12/2022	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	183
01/06/2023	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	182
01/12/2023	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	183
01/06/2024	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	183
01/12/2024	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	183
01/06/2025	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	0	182
01/12/2025	2,000	1,000	Certa	18.813.796.000	18.813.796.000	183

Annotazioni

Risultati asta:
1a 100.51 4.000 mld 01/09/2015
2a 100.51 474.188 mld 01/09/2015
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 101.77 3.000 mld 01/10/2015
5/6a 104.92 2.180.865 mld 02/11/2015
7/8a 106.00 1.686.743 mld 01/12/2015
9/10a 103.81 2.250 mld 04/01/2016
11/12a 105.13 3.000 mld 01/02/2016