

BTP 15/09/15-22 1.45% / IT0005135840

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
100,22 EUR	Republic of Italy	15/09/2022	0,725%	1,389%	1,207%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,22
Rendimento lordo	1,38901
Rendimento netto	1,20717
Cedola in corso	0,72500
Rateo lordo	0,61285
Rateo netto	0,53624
Vita residua	3,58356
Duration modificata	3,43653
Convessità	15,43231
Cedola successiva	0,72500
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	17.005.194.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/09/2015
Prezzo emissione	100,5400
Decorrenza prima cedola regolare	15/09/2015
Tasso annuale	1,4500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/09/2022
Data estinzione	15/09/2022
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	100,1000	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,2400	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,1760	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	99,8800	EUR
MOT	13/02/2019	100,2200	EUR
Euro MTS	13/02/2019	100,2700	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,2330	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,2010	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,1515	EUR

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
15/03/2019	1,450	0,725	Certa	17.005.194.000	0	181	Risultati asta:
15/09/2019	1,450	0,725	Certa	17.005.194.000	0	184	1a 100.54 4.000 mld 15/09/2015
15/03/2020	1,450	0,725	Certa	17.005.194.000	0	182	/2a 100.54 1.015.468 mld 15/09/2015
15/09/2020	1,450	0,725	Certa	17.005.194.000	0	184	Risultati riaperture:
15/03/2021	1,450	0,725	Certa	17.005.194.000	0	181	Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
15/09/2021	1,450	0,725	Certa	17.005.194.000	0	184	3/4a 101.44 2.500 mld 15/10/2015
15/03/2022	1,450	0,725	Certa	17.005.194.000	0	181	5/6a 103.13 2.500 mld 16/11/2015
15/09/2022	1,450	0,725	Certa	17.005.194.000	17.005.194.000	184	7/8a 102.95 3.000 mld 15/01/2016
							9/10a 102.55 2.500 mld 15/02/2016