

CCTeu 15/06/15-12/22 (0.70 AT) / IT0005137614

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
96,83 EUR	Republic of Italy	15/12/2022	0,233%	1,328%	1,266%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	96,83
Rendimento lordo	1,32817
Rendimento netto	1,26647
Cedola in corso	0,23300
Rateo lordo	0,07937
Rateo netto	0,06945
Vita residua	3,83288
Duration modificata	0,31260
Convessità	0,41031
Cedola successiva	0,23700
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	14.795.977.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/06/2015
Prezzo emissione	99,9300
Decorrenza prima cedola regolare	15/06/2015
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/12/2022
Data estinzione	15/12/2022
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	96,8300 EUR
Euro MTS	13/02/2019	96,8200 EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	96,7140 EUR
Euro TLX	13/02/2019	96,7850 EUR
Hi-MTF	13/02/2019	96,7910 EUR

Formula di indicizzazione

 $TV = (\text{Euribor } 6m + 0.70) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2\text{gg)}$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/06/2019	0,461	0,233	Certa	14.795.977.000	0	182
15/12/2019	0,000	0,237	Prevista	14.795.977.000	0	183
15/06/2020	0,000	0,237	Prevista	14.795.977.000	0	183
15/12/2020	0,000	0,237	Prevista	14.795.977.000	0	183
15/06/2021	0,000	0,237	Prevista	14.795.977.000	0	182
15/12/2021	0,000	0,237	Prevista	14.795.977.000	0	183
15/06/2022	0,000	0,237	Prevista	14.795.977.000	0	182
15/12/2022	0,000	0,237	Prevista	14.795.977.000	14.795.977.000	183

Annotazioni

Risultati asta:
 1a 99.93 3.000.000 mld 01/10/2015
 2a 99.93 900.000 mld 01/10/2015

Risultati riapertura:
 Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
 3/ 4a 101.12 1.491.930 mld 02/11/2015
 5/ 6a 101.71 1.000 mld 01/12/2015
 7/ 8a 101.71 1.500 mld 04/01/2016
 9/10a 101.36 1.750 mld 01/02/2016
 11/12a 100.57 2.000 mld 01/03/2016
 13/14a 101.48 1.500 mld 01/04/2016
 15/16a 99.72 1.090.500 mld 01/03/2017
 95.40 600.000 mln 11/09/2018 riacquisto

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/06/2015	15/12/2022	EURIBOR6M	1,000	0,700