

BTP 01/11/15-20 0.65% / IT0005142143

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
100,26 EUR	Republic of Italy	01/11/2020	0,325%	0,495%	0,414%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,26
Rendimento lordo	0,49513
Rendimento netto	0,41422
Cedola in corso	0,32500
Rateo lordo	0,19033
Rateo netto	0,16654
Vita residua	1,71233
Duration modificata	1,69695
Convessità	4,57942
Cedola successiva	0,32500
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	14.222.385.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/11/2015
Prezzo emissione	100,5700
Decorrenza prima cedola regolare	01/11/2015
Tasso annuale	0,6500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/11/2020
Data estinzione	01/11/2020
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	100,1000	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,2100	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,1940	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	100,0500	EUR
MOT	13/02/2019	100,2600	EUR
Euro MTS	13/02/2019	100,2200	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,2520	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,2490	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,1679	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/05/2019	0,650	0,325	Certa	14.222.385.000	0	181
01/11/2019	0,650	0,325	Certa	14.222.385.000	0	184
01/05/2020	0,650	0,325	Certa	14.222.385.000	0	182
01/11/2020	0,650	0,325	Certa	14.222.385.000	14.222.385.000	184

Annotazioni

Risultati asta:	
1a	100.57 4.000 mld 02/11/2015
2a	100.57 0.000 mld 02/11/2015
Risultati riaperture:	
Tranche	Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a	101.34 2.500 mld 01/12/2015
5/6a	100.37 2.250 mld 04/01/2016
7/8a	101.08 2.250 mld 01/02/2016
9/10a	100.98 2.250 mld 01/03/2016
11/12a	100.89 1.000 mld 03/04/2016