

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
86,55 EUR	Republic of Italy	01/03/2047	1,350%	3,480%	3,102%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	86,55
Rendimento lordo	3,47956
Rendimento netto	3,10175
Cedola in corso	1,35000
Rateo lordo	1,24558
Rateo netto	1,08988
Vita residua	28,05753
Duration modificata	18,24098
Convessità	445,32762
Cedola successiva	1,35000
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	16.672.369.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	09/02/2016
Prezzo emissione	99,1820
Decorrenza prima cedola regolare	01/03/2016
Data Prorata	09/02/2016
Tasso annuale	2,7000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/03/2047
Data estinzione	01/03/2047
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	86,1300	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	86,4900	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	86,3390	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	85,4500	EUR
MOT	13/02/2019	86,5500	EUR
Euro MTS	13/02/2019	86,6000	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	86,3660	EUR
Euro TLX	13/02/2019	86,5600	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	86,6500	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	181
01/09/2019	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	184
01/03/2020	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	182
01/09/2020	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	184
01/03/2021	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	181
01/09/2021	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	184
01/03/2022	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	181
01/09/2022	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	184
01/03/2023	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	181
01/09/2023	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	184
01/03/2024	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	182
01/09/2024	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	184
01/03/2025	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	181
01/09/2025	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	184
01/03/2026	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	181
01/09/2026	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	184
01/03/2027	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	181
01/09/2027	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	184
01/03/2028	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	0	182
01/03/2047	2,700	1,350	Certa	16.672.369.000	16.672.369.000	181

Annotazioni

Risultati asta:
1a 99.182 9.000 mld 09/02/2016
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
2a/3a 104.86 1.294.051 mld 15/04/2016
4a/5a 104.80 1.258.500 mld 15/06/2016
6a/7a 91.80 1.312.000 mld 15/11/2016
8a/9a 86.82 1.263.582 mld 15/02/2017
10a/11a 88.73 1.250.750 mld 15/05/2017
12a/13a 96.21 960.475 mld 15/03/2018