

BTP 01/03/16-01/06/26 1.60% / IT0005170839

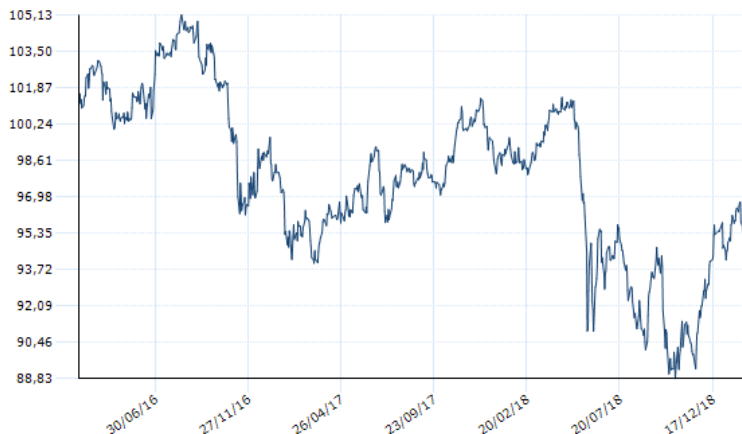
Grado di rischio calcolato

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
95,46 EUR	Republic of Italy	01/06/2026	0,800%	2,291%	2,083%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	95,46
Rendimento lordo	2,29063
Rendimento netto	2,08336
Cedola in corso	0,80000
Rateo lordo	0,33407
Rateo netto	0,29231
Vita residua	7,29589
Duration modificata	6,72679
Convessità	53,60475
Cedola successiva	0,80000
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	17.774.500.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	01/03/2016
Prezzo emissione	100,9700
Decorrenza prima cedola regolare	01/06/2016
Data Prorata	01/03/2016
Tasso annuale	1,6000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/06/2026
Data estinzione	01/06/2026
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	95,2900	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	95,4400	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	95,3650	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	94,9900	EUR
MOT	13/02/2019	95,4600	EUR
Euro MTS	13/02/2019	95,4500	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	95,4330	EUR
Euro TLX	13/02/2019	95,4300	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	95,4069	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/06/2019	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	182
01/12/2019	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	183
01/06/2020	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	183
01/12/2020	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	183
01/06/2021	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	182
01/12/2021	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	183
01/06/2022	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	182
01/12/2022	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	183
01/06/2023	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	182
01/12/2023	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	183
01/06/2024	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	183
01/12/2024	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	183
01/06/2025	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	182
01/12/2025	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	0	183
01/06/2026	1,600	0,800	Certa	17.774.500.000	17.774.500.000	182

Annotazioni

Risultati asta:
1a 100.97 4.000 mld 01/03/2016
/2a 100.97 1.200 mld 01/03/2016
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/ 4a 103.42 3.000 mld 01/04/2016
5/ 6a 100.86 2.500 mld 02/05/2016
7/ 8a 101.71 3.000 mld 01/06/2016
9/10a 102.32 2.500 mld 04/07/2016
11/12a 96.32 1.000 mld 01/03/2017