

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
97,67 EUR	Republic of Italy	15/03/2023	0,475%	1,547%	1,426%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,67
Rendimento lordo	1,54683
Rendimento netto	1,42567
Cedola in corso	0,47500
Rateo lordo	0,40152
Rateo netto	0,35133
Vita residua	4,07945
Duration modificata	3,93315
Convessità	19,57184
Cedola successiva	0,47500
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	16.247.343.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/03/2016
Prezzo emissione	101,0700
Decorrenza prima cedola regolare	15/03/2016
Tasso annuale	0,9500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/03/2023
Data estinzione	15/03/2023
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	97,4700	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	97,6100	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	97,5580	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	97,2400	EUR
MOT	13/02/2019	97,6700	EUR
Euro MTS	13/02/2019	97,6400	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	97,6140	EUR
Euro TLX	13/02/2019	97,6740	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	97,4735	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/03/2019	0,950	0,475	Certa	16.247.343.000	0	181
15/09/2019	0,950	0,475	Certa	16.247.343.000	0	184
15/03/2020	0,950	0,475	Certa	16.247.343.000	0	182
15/09/2020	0,950	0,475	Certa	16.247.343.000	0	184
15/03/2021	0,950	0,475	Certa	16.247.343.000	0	181
15/09/2021	0,950	0,475	Certa	16.247.343.000	0	184
15/03/2022	0,950	0,475	Certa	16.247.343.000	0	181
15/09/2022	0,950	0,475	Certa	16.247.343.000	0	184
15/03/2023	0,950	0,475	Certa	16.247.343.000	16.247.343.000	181

Annotazioni

Risultati asta:
1a 101.07 4.000 mld 15/03/2016
/2a 101.07 1.200 mld 15/03/2016
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 100.90 2.750 mld 15/04/2016
5/6a 100.51 2.722.843 mld 16/05/2016
7/8a 100.82 3.000 mld 15/06/2016
7/10a 102.10 2.500 mld 15/07/2016