

BTPi 11/04/16-24 0.40% (FOI) / IT0005174906

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
94,93 EUR	Republic of Italy	11/04/2024	0,200%	3,041%	2,988%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	94,93
Rendimento lordo	3,04063
Rendimento netto	2,98804
Cedola in corso	0,20000
Rateo lordo	0,13956
Rateo netto	0,12212
Vita residua	5,15616
Duration modificata	2,28191
Convessità	6,79575
Cedola successiva	0,20000
Coefficiente di inflazione	0,99533
Mercato di riferimento	MOT

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Italy
Tipo obbligazione	Inflation Linked
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	8.034.484.063
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	11/04/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	11/04/2016
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	11/04/2024
Data estinzione	11/04/2024
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	Si
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	12/02/2019	94,8100	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	94,8400	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	94,9380	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	94,9700	EUR
MOT	13/02/2019	94,9300	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	94,8510	EUR
Euro TLX	13/02/2019	94,9100	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	94,9900	EUR

Formula di indicizzazione

Buono del Tesoro Poliennale legato all'Inflazione Italiana (FOI ex tabacco)
 CEDOLA = $0,20 * VN * \text{Max} (IRI/IR0 ; 1)$ (minimo garantito)
 RIV CAPITALE = $VN * \text{Max} (IRI/IR0 - 1; 0)$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
11/04/2019	0,000	0,200	Prevista	8.034.484.063	0	182
11/10/2019	0,000	0,200	Prevista	8.034.484.063	0	183
11/04/2020	0,000	0,200	Prevista	8.034.484.063	0	183
11/10/2020	0,000	0,200	Prevista	8.034.484.063	0	183
11/04/2021	0,000	0,200	Prevista	8.034.484.063	0	182
11/10/2021	0,000	0,200	Prevista	8.034.484.063	0	183
11/04/2022	0,000	0,200	Prevista	8.034.484.063	0	182
11/10/2022	0,000	0,200	Prevista	8.034.484.063	0	183
11/04/2023	0,000	0,200	Prevista	8.034.484.063	0	182
11/10/2023	0,000	0,200	Prevista	8.034.484.063	0	183
11/04/2024	0,000	0,200	Prevista	8.034.484.063	8.034.484.063	183

Annotazioni

Dove:
 VN : Valore nominale dell'obbligazione
 IR0 : Inflazione di Riferimento del semestre (valore dell'indice alla data di pagamento della cedola immediatamente precedente oppure valore indice FOI massimo raggiunto nei semestri precedenti)
 Il numero indice usato come base per il calcolo dei coefficienti del primo semestre e' 99.63333
 Il Codice ISIN con Premio Fedeltà e' : IT0005174898.
 IRi : $IRm-3 + (d-1)/D * (IRm-2 - IRm-3)$
 m : mese di riferimento
 d : giorno di riferimento
 D : n. giorni del mese m

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
11/04/2016	11/04/2024	CPI Italia (FOI ex tabacco)	1,000	0,000

 Risultati asta:
 1/ 2a 100.00