

BTP 01/04/16-01/06/21 0.45% / IT0005175598

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
99,33 EUR	Republic of Italy	01/06/2021	0,225%	0,746%	0,690%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,33
Rendimento lordo	0,74617
Rendimento netto	0,68955
Cedola in corso	0,22500
Rateo lordo	0,09396
Rateo netto	0,08221
Vita residua	2,29315
Duration modificata	2,26501
Convessità	7,39501
Cedola successiva	0,22500
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	17.414.767.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	01/04/2016
Prezzo emissione	100,5500
Decorrenza prima cedola regolare	01/06/2016
Data Prorata	01/04/2016
Tasso annuale	0,4500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/06/2021
Data estinzione	01/06/2021
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
Bayerische Börse	12/02/2019	99,0130	EUR
MOT	13/02/2019	99,3300	EUR
Euro MTS	13/02/2019	99,1300	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	99,1730	EUR
Euro TLX	13/02/2019	99,3330	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	99,3200	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/06/2019	0,450	0,225	Certa	17.414.767.000	0	182
01/12/2019	0,450	0,225	Certa	17.414.767.000	0	183
01/06/2020	0,450	0,225	Certa	17.414.767.000	0	183
01/12/2020	0,450	0,225	Certa	17.414.767.000	0	183
01/06/2021	0,450	0,225	Certa	17.414.767.000	17.414.767.000	182

Annotazioni

Risultati asta:
 1a 100.55 3.500 mld 01/04/2016
 /2a 100.55 713.796 mld 01/04/2016

Risultati riapertura:
 Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
 3/ 4a 99.79 2.250 mld 02/05/2016
 5/ 6a 100.26 2.500 mld 01/06/2016
 7/ 8a 100.58 2.500 mld 04/07/2016
 9/10a 100.93 2.000 mld 01/08/2016
 11/12a 101.25 3.000 mld 01/09/2016