

BTP 01/03/16-01/09/36 2.25% / IT0005177909

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
87,64 EUR	Republic of Italy	01/09/2036	1,125%	3,196%	2,885%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	87,64
Rendimento lordo	3,19627
Rendimento netto	2,88530
Cedola in corso	1,12500
Rateo lordo	1,03798
Rateo netto	0,90824
Vita residua	17,55616
Duration modificata	13,74675
Convessità	230,78190
Cedola successiva	1,12500
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	14.900.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/03/2016
Prezzo emissione	99,3680
Decorrenza prima cedola regolare	01/03/2016
Tasso annuale	2,2500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/09/2036
Data estinzione	01/09/2036
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	12/02/2019	86,5100	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	86,6500	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	86,3130	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	86,2000	EUR
MOT	13/02/2019	87,6400	EUR
Euro MTS	13/02/2019	86,9000	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	86,7220	EUR
Euro TLX	13/02/2019	87,6700	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	87,7250	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	181
01/09/2019	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	184
01/03/2020	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	182
01/09/2020	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	184
01/03/2021	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	181
01/09/2021	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	184
01/03/2022	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	181
01/09/2022	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	184
01/03/2023	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	181
01/09/2023	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	184
01/03/2024	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	182
01/09/2024	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	184
01/03/2025	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	181
01/09/2025	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	184
01/03/2026	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	181
01/09/2026	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	184
01/03/2027	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	181
01/09/2027	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	184
01/03/2028	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	0	182
01/09/2036	2,250	1,125	Certa	14.900.000.000	14.900.000.000	184

Annotazioni

Risultati asta:
1a 99.368 6.500 mld 26/04/2016
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
2a/3a 106.36 1.750 mld 15/07/2016
4a/5a 105.70 1.250 mld 15/09/2016
6a/7a 95.89 1.500 mld 16/01/2017
8a/9a 91.59 2.000 mld 18/04/2017
10a/11a 92.99 1.500 mld 15/09/2017