

CCTeu 15/01/16-07/23 (0.70 AT) / IT0005185456

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	15/07/2023	0,233%	1,549%	1,487%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	95,46
Rendimento lordo	1,54896
Rendimento netto	1,48739
Cedola in corso	0,23300
Rateo lordo	0,03991
Rateo netto	0,03492
Vita residua	4,41370
Duration modificata	0,37184
Convessità	0,51010
Cedola successiva	0,23900
Mercato di riferimento	MOT

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Italy
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	15.429.861.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/01/2016
Prezzo emissione	100,3800
Decorrenza prima cedola regolare	15/01/2016
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/07/2023
Data estinzione	15/07/2023
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
MOT	13/02/2019	95,4600 EUR
Euro MTS	13/02/2019	95,8700 EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	95,0370 EUR
Euro TLX	13/02/2019	95,4710 EUR
Hi-MTF	13/02/2019	95,4376 EUR

Formula di indicizzazione

 $TV = (\text{Euribor } 6m + 0.70) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2\text{gg)}$

Flusso cedolare

Data	flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/07/2019		0,464	0,233	Certa	15.429.861.000	0	181
15/01/2020		0,000	0,239	Prevista	15.429.861.000	0	184
15/07/2020		0,000	0,239	Prevista	15.429.861.000	0	182
15/01/2021		0,000	0,239	Prevista	15.429.861.000	0	184
15/07/2021		0,000	0,239	Prevista	15.429.861.000	0	181
15/01/2022		0,000	0,239	Prevista	15.429.861.000	0	184
15/07/2022		0,000	0,239	Prevista	15.429.861.000	0	181
15/01/2023		0,000	0,239	Prevista	15.429.861.000	0	184
15/07/2023		0,000	0,239	Prevista	15.429.861.000	15.429.861.000	181

Annotazioni

Risultati asta:
1a 100.38 3.000.000 mld 02/05/2016
2a 100.38 770.725 mld 02/05/2016
Risultati riapertura:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/ 4a 100.79 2.000.000 mld 01/06/2016
5/ 6a 100.51 1.750.000 mld 04/07/2016
7/ 8a 100.93 2.000.000 mld 01/08/2016
9/10a 101.35 1.750.000 mld 01/09/2016
11/12a 101.24 2.000.000 mld 03/10/2016

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/01/2016	15/07/2023	EURIBOR6M	1,000	0,700