

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
95,48 EUR	Republic of Italy	15/10/2023	0,325%	1,666%	1,577%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	95,48
Rendimento lordo	1,66609
Rendimento netto	1,57707
Cedola in corso	0,32500
Rateo lordo	0,21964
Rateo netto	0,19219
Vita residua	4,66575
Duration modificata	4,51860
Convessità	25,08731
Cedola successiva	0,32500
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	14.381.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	15/09/2016
Prezzo emissione	99,7000
Decorrenza prima cedola regolare	15/10/2016
Data Prorata	15/09/2016
Tasso annuale	0,6500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/10/2023
Data estinzione	15/10/2023
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	12/02/2019	94,9600	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	95,0700	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	94,8660	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	94,8000	EUR
MOT	13/02/2019	95,4800	EUR
Euro MTS	13/02/2019	95,4700	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	95,1170	EUR
Euro TLX	13/02/2019	95,4810	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	95,4591	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/04/2019	0,650	0,325	Certa	14.381.000.000	0	182
15/10/2019	0,650	0,325	Certa	14.381.000.000	0	183
15/04/2020	0,650	0,325	Certa	14.381.000.000	0	183
15/10/2020	0,650	0,325	Certa	14.381.000.000	0	183
15/04/2021	0,650	0,325	Certa	14.381.000.000	0	182
15/10/2021	0,650	0,325	Certa	14.381.000.000	0	183
15/04/2022	0,650	0,325	Certa	14.381.000.000	0	182
15/10/2022	0,650	0,325	Certa	14.381.000.000	0	183
15/04/2023	0,650	0,325	Certa	14.381.000.000	0	182
15/10/2023	0,650	0,325	Certa	14.381.000.000	14.381.000.000	183

Annotazioni

Risultati asta:
1a 99.70 4.000 mld 15/09/2016
/2a 99.70 0.000 mld 15/09/2016
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 98.82 2.500 mld 17/10/2016
5/6a 95.30 2.250 mld 15/11/2016
7/8a 96.80 2.750 mld 16/01/2017
9/10a 94.12 2.500 mld 15/02/2017