

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
98,42 EUR	Republic of Italy	01/11/2021	0,175%	0,943%	0,899%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,42
Rendimento lordo	0,94285
Rendimento netto	0,89858
Cedola in corso	0,17500
Rateo lordo	0,10249
Rateo netto	0,08968
Vita residua	2,71233
Duration modificata	2,67391
Convessità	9,82238
Cedola successiva	0,17500
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	15.955.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	03/10/2016
Prezzo emissione	100,3300
Decorrenza prima cedola regolare	01/11/2016
Data Prorata	03/10/2016
Tasso annuale	0,3500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/11/2021
Data estinzione	01/11/2021
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	97,9480	EUR
MOT	13/02/2019	98,4200	EUR
Euro MTS	13/02/2019	98,3300	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	98,1260	EUR
Euro TLX	13/02/2019	98,4030	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	98,4245	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/05/2019	0,350	0,175	Certa	15.955.000.000	0	181
01/11/2019	0,350	0,175	Certa	15.955.000.000	0	184
01/05/2020	0,350	0,175	Certa	15.955.000.000	0	182
01/11/2020	0,350	0,175	Certa	15.955.000.000	0	184
01/05/2021	0,350	0,175	Certa	15.955.000.000	0	181
01/11/2021	0,350	0,175	Certa	15.955.000.000	15.955.000.000	184

Annotazioni

Risultati asta:	
1a	100.33 4.000 mld 03/10/2016
/2a	100.33 1.000 mld 03/10/2016
Risultati riapertura:	
Tranche	Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a	98.91 2.750 mld 01/11/2016
5/6a	97.33 1.750 mld 01/12/2016
7/8a	99.12 2.500 mld 02/01/2017
9/10a	97.39 2.750 mld 01/02/2017