

BTP 01/09/16-01/06/67 2.80% / IT0005217390

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
82,8 EUR	Republic of Italy	01/03/2067	1,400%	3,577%	3,168%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	82,8
Rendimento lordo	3,57702
Rendimento netto	3,16808
Cedola in corso	1,40000
Rateo lordo	1,29171
Rateo netto	1,13025
Vita residua	48,07123
Duration modificata	23,35571
Convessità	841,74899
Cedola successiva	1,40000
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	6.633.214.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/09/2016
Prezzo emissione	99,1940
Decorrenza prima cedola regolare	01/09/2016
Tasso annuale	2,8000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/03/2067
Data estinzione	01/03/2067
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	06/02/2019	84,4000	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	81,7500	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	81,3370	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	81,3700	EUR
MOT	13/02/2019	82,8000	EUR
Euro MTS	13/02/2019	82,7800	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	82,1000	EUR
Euro TLX	13/02/2019	82,8000	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	82,9877	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	181
01/09/2019	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	184
01/03/2020	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	182
01/09/2020	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	184
01/03/2021	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	181
01/09/2021	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	184
01/03/2022	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	181
01/09/2022	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	184
01/03/2023	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	181
01/09/2023	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	184
01/03/2024	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	182
01/09/2024	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	184
01/03/2025	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	181
01/09/2025	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	184
01/03/2026	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	181
01/09/2026	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	184
01/03/2027	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	181
01/09/2027	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	184
01/03/2028	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	0	182
01/03/2067	2,800	1,400	Certa	6.633.214.000	6.633.214.000	181

Annotazioni

Risultati asta:
1/ 99.194 5.000 mld 11/10/2016
Risultati riapertura:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
2/3a 85.38 750.000 mld 03/04/2017
4/5a 90.86 750.000 mld 01/02/2018