

BTPi 24/10/16-24 CUM 0.35% (FOI) / IT0005217762

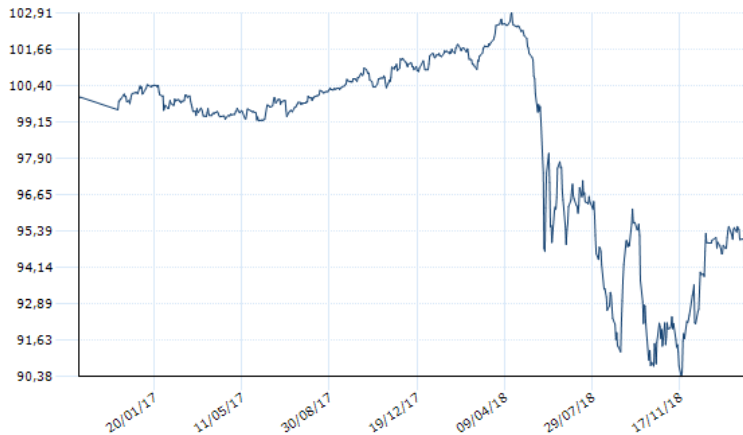
Grado di rischio calcolato

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
94,14 EUR	Republic of Italy	24/10/2024	0,175%	3,114%	3,062%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	94,14
Rendimento lordo	3,11416
Rendimento netto	3,06188
Cedola in corso	0,17500
Rateo lordo	0,10962
Rateo netto	0,09591
Vita residua	5,69315
Duration modificata	2,49781
Convessità	8,08209
Cedola successiva	0,17500
Coefficiente di inflazione	0,99371
Mercato di riferimento	MOT

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Italy
Tipo obbligazione	Inflation Linked
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	5.224.511.527
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	24/10/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	24/10/2016
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	24/10/2024
Data estinzione	24/10/2024
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	Si
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,400
Regime fiscale	Tassato 12,5%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	12/02/2019	93,6600	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	93,8500	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	94,0120	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	94,0800	EUR
MOT	13/02/2019	94,1400	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	94,1720	EUR
Euro TLX	13/02/2019	94,0600	EUR

Formula di indicizzazione

Buono del Tesoro Poliennale legato all'Inflazione Italiana (FOI ex tabacco) CUM Premio Fedelta'.
 CEDOLA= 0.175 * VN * Max (IRi/IR0 ; 1) (minimo garantito)
 RIV CAPITALE= VN * Max (IRi/IR0 - 1; 0)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
24/04/2019	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	0	182
24/10/2019	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	0	183
24/04/2020	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	0	183
24/10/2020	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	0	183
24/04/2021	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	0	182
24/10/2021	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	0	183
24/04/2022	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	0	182
24/10/2022	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	0	183
24/04/2023	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	0	182
24/10/2023	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	0	183
24/04/2024	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	0	183
24/10/2024	0,350	0,175	Prevista	5.224.511.527	5.224.511.527	183

Annotazioni

Dove:
 VN : Valore nominale dell'obbligazione
 IR0 : Inflazione di Riferimento del semestre (valore dell'indice alla data di pagamento della cedola immediatamente precedente oppure valore indice FOI massimo raggiunto nei semestri precedenti)
 Il numero indice usato come base per il calcolo dei coefficienti del primo semestre e' 100,14839
 Il Codice ISIN SENZA Premio Fedelta' e' : IT0005217770.
 IRi : IRm-3 + (d-1)/D * (IRm-2 - IRm-3)
 m : mese di riferimento
 d : giorno di riferimento
 D : n. giorni del mese m

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
24/10/2016	24/10/2024	CPI Italia (FOI ex tabacco)	1,000	0,000

Risultati asta:
 1/ 100.000 8.598.516 mld 18/05/2018