

BTP 15/10/16-19 0.05% / IT0005217929

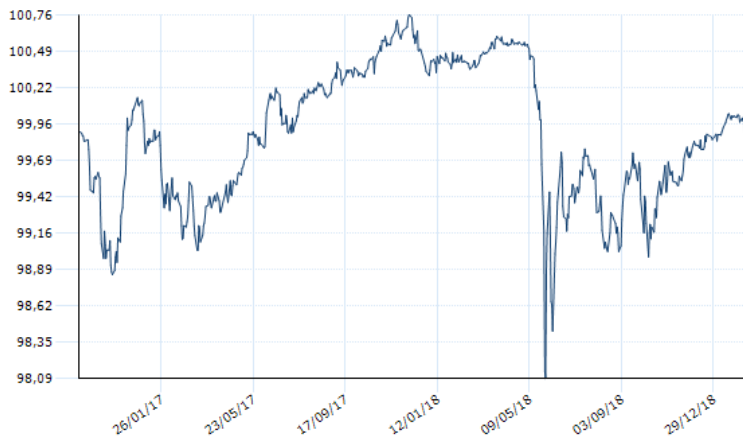
Grado di rischio calcolato

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
99,99 EUR	Republic of Italy	15/10/2019	0,025%	0,066%	0,059%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,989
Rendimento lordo	0,06561
Rendimento netto	0,05947
Cedola in corso	0,02500
Rateo lordo	0,01690
Rateo netto	0,01478
Vita residua	0,66301
Duration modificata	0,66246
Convessità	1,10093
Cedola successiva	0,02500
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	13.832.596.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/10/2016
Prezzo emissione	100,0500
Decorrenza prima cedola regolare	15/10/2016
Tasso annuale	0,0500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/10/2019
Data estinzione	15/10/2019
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	99,8500	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	99,9500	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	99,8980	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	99,8900	EUR
MOT	13/02/2019	99,9890	EUR
Euro MTS	13/02/2019	99,9800	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	99,9630	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,0150	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,0390	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/04/2019	0,050	0,025	Certa	13.832.596.000	0	182
15/10/2019	0,050	0,025	Certa	13.832.596.000	13.832.596.000	183

Annotazioni

 Risultati asta:
 1a 100.05 4.000 mld 17/10/2016
 2a 100.05 0.000 mld 17/10/2016

Risultati riaperture:

 Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
 3/4a 99.27 2.750 mld 15/11/2016
 5/6a 99.97 3.000 mld 16/01/2017
 7/8a 99.47 2.750 mld 15/02/2017
 9/10a 99.18 2.750 mld 15/03/2017