

CCTeu 15/08/16-02/24 (0.75 AT) / IT0005218968

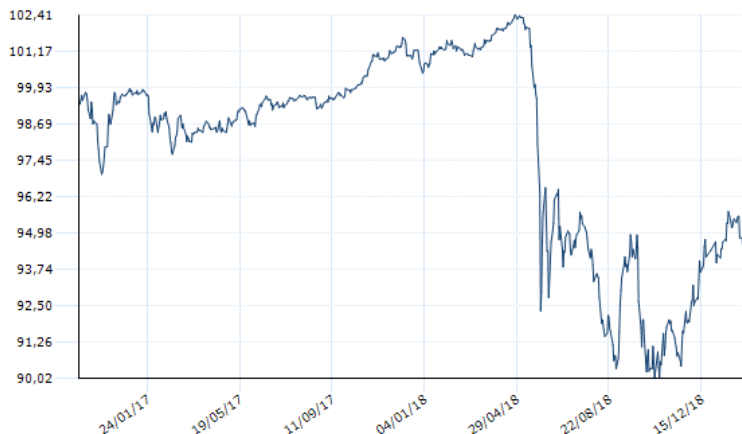
Grado di rischio calcolato

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
94,22 EUR	Republic of Italy	15/02/2024	0,247%	1,740%	1,669%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	94,22
Rendimento lordo	1,74039
Rendimento netto	1,66920
Cedola in corso	0,26100
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	5,00274
Duration modificata	0,43414
Convessità	0,62262
Cedola successiva	0,26100
Mercato di riferimento	MOT

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Italy
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	14.956.168.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/08/2016
Prezzo emissione	99,8000
Decorrenza prima cedola regolare	15/08/2016
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/02/2024
Data estinzione	15/02/2024
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
MOT	13/02/2019	94,2200 EUR
Euro MTS	13/02/2019	94,4000 EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	93,8110 EUR
Euro TLX	13/02/2019	94,3310 EUR
Hi-MTF	13/02/2019	93,7900 EUR

Formula di indicizzazione

 $TV = (\text{Euribor } 6m + 0.75) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2gg)$

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/02/2019	0,484	0,247	Certa	14.956.168.000	0	184
15/08/2019	0,519	0,261	Certa	14.956.168.000	0	181
15/02/2020	0,000	0,261	Prevista	14.956.168.000	0	184
15/08/2020	0,000	0,261	Prevista	14.956.168.000	0	182
15/02/2021	0,000	0,261	Prevista	14.956.168.000	0	184
15/08/2021	0,000	0,261	Prevista	14.956.168.000	0	181
15/02/2022	0,000	0,261	Prevista	14.956.168.000	0	184
15/08/2022	0,000	0,261	Prevista	14.956.168.000	0	181
15/02/2023	0,000	0,261	Prevista	14.956.168.000	0	184
15/08/2023	0,000	0,261	Prevista	14.956.168.000	0	181
15/02/2024	0,000	0,261	Prevista	14.956.168.000	14.956.168.000	184

Annotazioni

Risultati asta:
1a 99.80 3.250 mld 01/11/2016
2a 99.80 0.000 mld 01/11/2016
Risultati riapertura:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/ 4a 97.01 1.949.500 mld 01/12/2016
5/ 6a 99.93 1.750.000 mld 02/01/2017
7/ 8a 98.84 2.250.000 mld 01/02/2017
11/12a 98.70 2.500.000 mld 03/04/2017

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/08/2016	15/02/2024	EURIBOR6M	1,000	0,750