

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
92,54 EUR	Republic of Italy	01/09/2033	1,225%	3,111%	2,782%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	92,54
Rendimento lordo	3,11141
Rendimento netto	2,78173
Cedola in corso	1,22500
Rateo lordo	1,13025
Rateo netto	0,98897
Vita residua	14,55342
Duration modificata	11,71123
Convessità	166,50656
Cedola successiva	1,22500
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	15.905.228.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/09/2016
Prezzo emissione	99,1310
Decorrenza prima cedola regolare	01/09/2016
Tasso annuale	2,4500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/09/2033
Data estinzione	01/09/2033
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	91,5900	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	91,7100	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	91,5200	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	91,3400	EUR
MOT	13/02/2019	92,5400	EUR
Euro MTS	13/02/2019	92,6200	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	91,8260	EUR
Euro TLX	13/02/2019	92,5200	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	91,7717	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	181
01/09/2019	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	184
01/03/2020	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	182
01/09/2020	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	184
01/03/2021	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	181
01/09/2021	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	184
01/03/2022	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	181
01/09/2022	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	184
01/03/2023	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	181
01/09/2023	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	184
01/03/2024	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	182
01/09/2024	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	184
01/03/2025	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	181
01/09/2025	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	184
01/03/2026	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	181
01/09/2026	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	184
01/03/2027	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	181
01/09/2027	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	184
01/03/2028	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	0	182
01/09/2033	2,450	1,225	Certa	15.905.228.000	15.905.228.000	184

Annotazioni

Risultati asta:
1a 99.131 6.000 mld 25/01/2017
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
2a/3a 94.76 1.386.500 mld 15/03/2017
4a/5a 96.08 1.225.500 mld 17/07/2017
6a/7a 101.15 1.500 mld 15/11/2017
8a/9a 100.14 1.289.525 mld 15/03/2018
10a/11a 101.11 1.500 mld 15/05/2018
12a/13a 93.12 1.250 mld 16/07/2018
14a/15a 86.56 941.700 mld 15/10/2018