

CCTeu 15/04/17-10/24 (1.10 AT) / IT0005252520

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
94,55 EUR	Republic of Italy	15/10/2024	0,421%	1,907%	1,785%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	94,55
Rendimento lordo	1,90736
Rendimento netto	1,78490
Cedola in corso	0,42100
Rateo lordo	0,28452
Rateo netto	0,24896
Vita residua	5,66849
Duration modificata	0,16267
Convessità	0,18914
Cedola successiva	0,44100
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	15.354.675.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/04/2017
Prezzo emissione	99,5000
Decorrenza prima cedola regolare	15/04/2017
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/10/2024
Data estinzione	15/10/2024
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	94,5500 EUR
Euro MTS	13/02/2019	94,4500 EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	94,0940 EUR
Euro TLX	13/02/2019	94,5700 EUR
Hi-MTF	13/02/2019	94,5437 EUR

Formula di indicizzazione

 $TV = (\text{Euribor } 6m + 1.10) \times \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg)}$

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/04/2019	0,833	0,421	Certa	15.354.675.000	0	182
15/10/2019	0,000	0,441	Prevista	15.354.675.000	0	183
15/04/2020	0,000	0,441	Prevista	15.354.675.000	0	183
15/10/2020	0,000	0,441	Prevista	15.354.675.000	0	183
15/04/2021	0,000	0,441	Prevista	15.354.675.000	0	182
15/10/2021	0,000	0,441	Prevista	15.354.675.000	0	183
15/04/2022	0,000	0,441	Prevista	15.354.675.000	0	182
15/10/2022	0,000	0,441	Prevista	15.354.675.000	0	183
15/04/2023	0,000	0,441	Prevista	15.354.675.000	0	182
15/10/2023	0,000	0,441	Prevista	15.354.675.000	0	183
15/04/2024	0,000	0,441	Prevista	15.354.675.000	0	183
15/10/2024	0,000	0,441	Prevista	15.354.675.000	15.354.675.000	183

Annotazioni

Risultati asta:
1/ 99.50 3.500 mld 02/05/2017
2a 99.50 1.050 mld 02/05/2017
Risultati riapertura:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 99.57 1.750 mld 01/06/2017
5/6a 100.24 1.500 mld 04/07/2017
7/8a 100.62 1.500 mld 01/08/2017
9/10a 100.35 1.750 mld 01/09/2017
11/12a 100.75 1.500 mld 02/10/2017
13/14a 91.45 995.300 mld 03/09/2018
15/16a 92.28 608.875 mld 03/12/2018

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/04/2017	15/10/2024	EURIBOR6M	1,000	1,100