

BTP 04/07/17-01/08/27 2.05% / IT0005274805

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
96,31 EUR	Republic of Italy	01/08/2027	1,025%	2,552%	2,277%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	96,31
Rendimento lordo	2,55196
Rendimento netto	2,27698
Cedola in corso	1,02500
Rateo lordo	0,07928
Rateo netto	0,06937
Vita residua	8,46301
Duration modificata	7,59977
Convessità	68,31357
Cedola successiva	1,02500
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	19.196.628.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	04/07/2017
Prezzo emissione	99,0800
Decorrenza prima cedola regolare	01/08/2017
Data Prorata	04/07/2017
Tasso annuale	2,0500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/08/2027
Data estinzione	01/08/2027
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	95,6500	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	95,7700	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	95,5400	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	95,4300	EUR
MOT	13/02/2019	96,3100	EUR
Euro MTS	13/02/2019	96,3200	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	95,8320	EUR
Euro TLX	13/02/2019	96,3300	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	96,1643	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/08/2019	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	181
01/02/2020	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	184
01/08/2020	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	182
01/02/2021	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	184
01/08/2021	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	181
01/02/2022	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	184
01/08/2022	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	181
01/02/2023	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	184
01/08/2023	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	181
01/02/2024	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	184
01/08/2024	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	182
01/02/2025	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	184
01/08/2025	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	181
01/02/2026	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	184
01/08/2026	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	181
01/02/2027	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	0	184
01/08/2027	2,050	1,025	Certa	19.196.628.000	19.196.628.000	181

Annotazioni

Risultati asta:
1a 99.08 3.846,628 mld 04/07/2017
2a 99.08 1.200 mld 04/07/2017
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 99.14 2.250 mld 01/08/2017
5/6a 99.71 2.250 mld 01/09/2017
7/8a 98.90 2.000 mld 02/10/2017
9/10a 101.76 2.500 mld 01/11/2017
11/12a 102.89 1.750 mld 01/12/2017
13/14a 101.70 1.500 mld 02/01/2018