

BTP 15/09/17-15/11/24 1.45% / IT0005282527

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
96,86 EUR	Republic of Italy	15/11/2024	0,725%	2,039%	1,846%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	96,86
Rendimento lordo	2,03921
Rendimento netto	1,84590
Cedola in corso	0,72500
Rateo lordo	0,36851
Rateo netto	0,32244
Vita residua	5,75342
Duration modificata	5,40603
Convessità	35,35143
Cedola successiva	0,72500
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	15.550.849.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	15/09/2017
Prezzo emissione	99,5600
Decorrenza prima cedola regolare	15/11/2017
Data Prorata	15/09/2017
Tasso annuale	1,4500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/11/2024
Data estinzione	15/11/2024
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
Frankfurter Börse	12/02/2019	96,2500	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	96,3600	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	96,1570	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	96,0600	EUR
MOT	13/02/2019	96,8600	EUR
Euro MTS	13/02/2019	96,8200	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	96,4050	EUR
Euro TLX	13/02/2019	96,8800	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	96,7488	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/05/2019	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	0	181
15/11/2019	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	0	184
15/05/2020	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	0	182
15/11/2020	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	0	184
15/05/2021	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	0	181
15/11/2021	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	0	184
15/05/2022	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	0	181
15/11/2022	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	0	184
15/05/2023	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	0	181
15/11/2023	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	0	184
15/05/2024	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	0	182
15/11/2024	1,450	0,725	Certa	15.550.849.000	15.550.849.000	184

Annotazioni

Risultati asta:
1a 99.56 4.000,000 mld 15/09/2017
2a 99.56 500 mld 15/09/2017
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 99.51 2.000,000 mld 16/10/2017
5/6a 101.61 2.500,000 mld 15/11/2017
7/8a 100.68 3.300,000 mld 15/01/2018
9/10a 100.14 2.927,432 mld 15/02/2018