

BTP 15/10/17-20 0.20% / IT0005285041

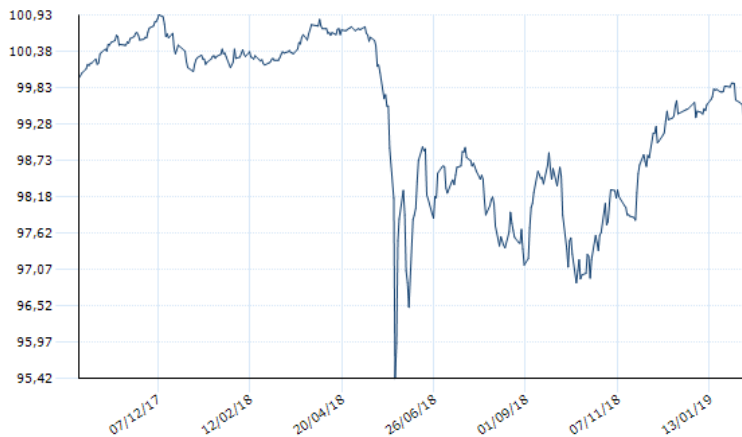
Grado di rischio calcolato

| | | | | | | | | |
|-------------------|---|---|---|---|---|---|---|-----------------|
| 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 |
| 99,58 EUR | Republic of Italy | 15/10/2020 | 0,100% | 0,456% | 0,431% |



Analisi

| | |
|------------------------|------------|
| Data ultima quotazione | 13/02/2019 |
| Data valutazione | 13/02/2019 |
| Data valuta | 15/02/2019 |
| Prezzo | 99,576 |
| Rendimento lordo | 0,45586 |
| Rendimento netto | 0,43079 |
| Cedola in corso | 0,10000 |
| Rateo lordo | 0,06758 |
| Rateo netto | 0,05913 |
| Vita residua | 1,66575 |
| Duration modificata | 1,65520 |
| Convessità | 4,39084 |
| Cedola successiva | 0,10000 |
| 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 | 15.226.420.000 |
| Nominale obbligazione | 1.000,00 |
| Taglio minimo | 1.000,00 |
| Corso | Secco |
| Sottoscrizione | Regular |
| Data emissione | 15/10/2017 |
| Prezzo emissione | 100,1500 |
| Decorrenza prima cedola regolare | 15/10/2017 |
| Tasso annuale | 0,2000 |
| Frequenza cedola | 2 |
| Base rateo cedola | ACT/ACT |
| Subordinato | NO |

Rimborso

| | |
|-----------------------------|-----------------|
| Tipo ammortamento | Unica Soluzione |
| Data 1° rimborso | 15/10/2020 |
| Data estinzione | 15/10/2020 |
| 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 |
|------------------|------------|---------|--------|
| Bayerische Börse | 12/02/2019 | 99,3590 | EUR |
| MOT | 13/02/2019 | 99,5760 | EUR |
| Euro MTS | 13/02/2019 | 99,5700 | EUR |
| Börse Stuttgart | 12/02/2019 | 99,4560 | EUR |
| Euro TLX | 13/02/2019 | 99,5770 | EUR |
| Hi-MTF | 13/02/2019 | 99,5150 | EUR |

Flusso cedolare

| Data flusso | Tasso annuo % | Val. cedola | Tipo cedola | Val. residuo | Val. ammortato | Giorni |
|-------------|---------------|-------------|-------------|----------------|----------------|--------|
| 15/04/2019 | 0,200 | 0,100 | Certa | 15.226.420.000 | 0 | 182 |
| 15/10/2019 | 0,200 | 0,100 | Certa | 15.226.420.000 | 0 | 183 |
| 15/04/2020 | 0,200 | 0,100 | Certa | 15.226.420.000 | 0 | 183 |
| 15/10/2020 | 0,200 | 0,100 | Certa | 15.226.420.000 | 15.226.420.000 | 183 |

Annotazioni

| | | | |
|-----------------------|--------|-------------------|------------------|
| Risultati asta: | | | |
| 1a | 100.15 | 4.000 mld | 16/10/2017 |
| /2a | 100.15 | 1.200 mld | 17/10/2017 |
| Risultati riapertura: | | | |
| Tranche | Prezzo | Importo assegnato | Data regolamento |
| 3a/4a | 100.65 | 2.000 mld | 15/11/2017 |
| 5a/6a | 100.44 | 3.000 mld | 15/01/2018 |
| 7a/8a | 100.40 | 2.500 mld | 15/02/2018 |
| 9a/10a | 100.51 | 2.500 mld | 15/03/2018 |