

CTZ 30/10/17-30/10/19 (-0.167%) / IT0005289274

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
99,95 EUR	Republic of Italy	30/10/2019	0,000%	0,067%	0,067%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,952
Rendimento lordo	0,06727
Rendimento netto	0,06727
Cedola in corso	N/A
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	0,70411
Duration modificata	0,70364
Convessità	1,19828
Cedola successiva	N/A
Mercato di riferimento	MOT

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Italy
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Zero Coupon
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	12.701.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Prezzo Tel-quel
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	30/10/2017
Prezzo emissione	100,3340
Decorrenza prima cedola regolare	30/10/2017
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	30/10/2019
Data estinzione	30/10/2019
Base rateo capitale	Composta
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	99,9520	EUR
Euro MTS	13/02/2019	99,9090	EUR
Euro TLX	13/02/2019	99,9590	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	99,9459	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
30/10/2019	0,000	0,000	Certa	12.701.000.000	12.701.000.000	730

Annotazioni

 Risultati asta:
 1a 100.334 3.000 mld 30/10/2017
 2a 100.334 900.000 mld 30/10/2017

 Risultati riaperture:
 Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
 3/4a 100.649 2.000 mld 29/11/2017
 5/6a 100.405 2.500 mld 02/01/2018
 7/8a 100.45 2.000 mld 30/01/2018
 9/10a 100.362 2.000 mld 27/02/2018