

CCTeu 15/10/17-04/25 (0.95 AT) / IT0005311508

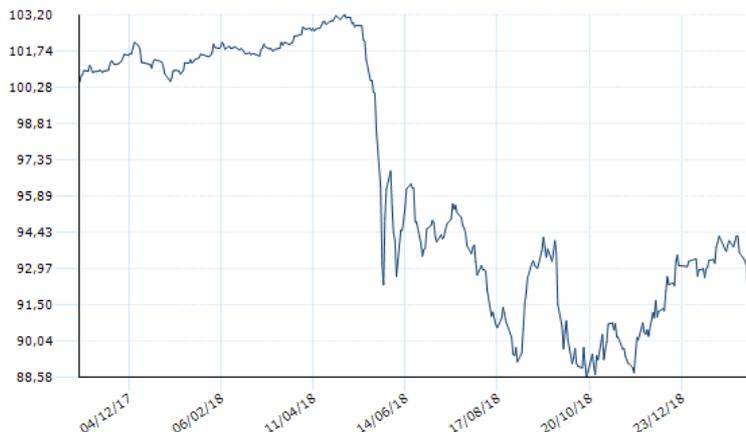
Grado di rischio calcolato

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
92,85 EUR	Republic of Italy	15/04/2025	0,345%	1,973%	1,877%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	92,85
Rendimento lordo	1,97251
Rendimento netto	1,87705
Cedola in corso	0,34500
Rateo lordo	0,23316
Rateo netto	0,20401
Vita residua	6,16712
Duration modificata	0,08427
Convessità	0,09138
Cedola successiva	0,36400
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	15.136.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/10/2017
Prezzo emissione	100,5600
Decorrenza prima cedola regolare	15/10/2017
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/04/2025
Data estinzione	15/04/2025
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	92,8500 EUR
Euro MTS	13/02/2019	92,9000 EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	92,2940 EUR
Euro TLX	13/02/2019	92,7700 EUR
Hi-MTF	13/02/2019	92,7200 EUR

Formula di indicizzazione

 $TV = (\text{Euribor } 6m + 0.95) \times \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg)}$

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/04/2019	0,683	0,345	Certa	15.136.000.000	0	182
15/10/2019	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	0	183
15/04/2020	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	0	183
15/10/2020	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	0	183
15/04/2021	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	0	182
15/10/2021	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	0	183
15/04/2022	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	0	182
15/10/2022	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	0	183
15/04/2023	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	0	182
15/10/2023	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	0	183
15/04/2024	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	0	183
15/10/2024	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	0	183
15/04/2025	0,000	0,364	Prevista	15.136.000.000	15.136.000.000	182

Annotazioni

Risultati asta:
 1/ 99.50 3.500 mld 01/11/2017
 2a 99.50 1.050 mld 01/11/2017
 Risultati riapertura:
 Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
 3/4a 101.57 1.750 mld 01/12/2017
 5/6a 101.43 2.000 mld 02/01/2018
 7/8a 101.86 2.000 mld 01/02/2018
 9/10a 101.84 1.710.500 mld 01/03/2018
 11/12a 102.26 2.300 mld 03/04/2018

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/10/2017	15/04/2025	EURIBOR6M	1,000	0,950