

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
93,75 EUR	Republic of Italy	01/09/2038	1,475%	3,415%	3,025%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	93,75
Rendimento lordo	3,41540
Rendimento netto	3,02519
Cedola in corso	1,47500
Rateo lordo	1,36091
Rateo netto	1,19080
Vita residua	19,55616
Duration modificata	14,13004
Convessità	254,58479
Cedola successiva	1,47500
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	11.963.750.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/09/2017
Prezzo emissione	99,7660
Decorrenza prima cedola regolare	01/09/2017
Tasso annuale	2,9500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/09/2038
Data estinzione	01/09/2038
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	92,5900	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	92,4300	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	92,3190	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	92,2200	EUR
MOT	13/02/2019	93,7500	EUR
Euro MTS	13/02/2019	93,6900	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	92,8290	EUR
Euro TLX	13/02/2019	93,7600	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	93,8100	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/03/2019	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	181
01/09/2019	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	184
01/03/2020	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	182
01/09/2020	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	184
01/03/2021	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	181
01/09/2021	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	184
01/03/2022	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	181
01/09/2022	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	184
01/03/2023	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	181
01/09/2023	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	184
01/03/2024	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	182
01/09/2024	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	184
01/03/2025	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	181
01/09/2025	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	184
01/03/2026	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	181
01/09/2026	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	184
01/03/2027	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	181
01/09/2027	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	184
01/03/2028	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	0	182
01/09/2038	2,950	1,475	Certa	11.963.750.000	11.963.750.000	184

Annotazioni

Risultati asta:
1a 99.766 9.000 mld 17/01/2018
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
2/3a 105.86 1.463.750 mld 16/04/2018
4/5a 95.53 1.250 mld 16/07/2018
6/7a 87.46 1.250 mld 15/11/2018