

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
95,39 EUR	Republic of Italy	01/02/2028	1,000%	2,594%	2,330%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	95,39
Rendimento lordo	2,59432
Rendimento netto	2,32955
Cedola in corso	1,00000
Rateo lordo	0,07735
Rateo netto	0,06768
Vita residua	8,96712
Duration modificata	8,01812
Convessità	75,76810
Cedola successiva	1,00000
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	20.263.639.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/02/2018
Prezzo emissione	99,5500
Decorrenza prima cedola regolare	01/02/2018
Tasso annuale	2,0000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/02/2028
Data estinzione	01/02/2028
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	94,8100	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	94,9300	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	94,6970	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	94,4000	EUR
MOT	13/02/2019	95,3900	EUR
Euro MTS	13/02/2019	95,4200	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	94,9930	EUR
Euro TLX	13/02/2019	95,3900	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	95,2920	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/08/2019	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	181
01/02/2020	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	184
01/08/2020	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	182
01/02/2021	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	184
01/08/2021	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	181
01/02/2022	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	184
01/08/2022	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	181
01/02/2023	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	184
01/08/2023	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	181
01/02/2024	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	184
01/08/2024	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	182
01/02/2025	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	184
01/08/2025	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	181
01/02/2026	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	184
01/08/2026	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	181
01/02/2027	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	184
01/08/2027	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	0	181
01/02/2028	2,000	1,000	Certa	20.263.639.000	20.263.639.000	184

Annotazioni

Risultati asta:
1a 99.55 4.500.000 mld 01/02/2018
2a 99.55 962.736 mld 01/02/2018
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3a/4a 99.55 2.300 mld 01/03/2018
5a/6a 101.57 3.450 mld 03/04/2018
7a/8a 102.78 3.000 mld 02/05/2018
9a/10a 91.85 1.820.983 mld 01/06/2018
11a/12a 93.71 2.500 mld 02/07/2018
13a/14a 96.11 738.650 mld 02/01/2019