

BTP 15/04/18-15/04/21 0.05% / IT0005330961

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
98,57 EUR	Republic of Italy	15/04/2021	0,025%	0,718%	0,712%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,57
Rendimento lordo	0,71824
Rendimento netto	0,71193
Cedola in corso	0,02500
Rateo lordo	0,01690
Rateo netto	0,01478
Vita residua	2,16438
Duration modificata	2,14770
Convessità	6,74684
Cedola successiva	0,02500
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	15.441.478.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/04/2018
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	15/04/2018
Tasso annuale	0,0500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/04/2021
Data estinzione	15/04/2021
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	98,2200	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	98,3000	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	98,1560	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	98,1600	EUR
MOT	13/02/2019	98,5700	EUR
Euro MTS	13/02/2019	98,5500	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	98,3250	EUR
Euro TLX	13/02/2019	98,5610	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	98,5820	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/04/2019	0,050	0,025	Certa	15.441.478.000	0	182
15/10/2019	0,050	0,025	Certa	15.441.478.000	0	183
15/04/2020	0,050	0,025	Certa	15.441.478.000	0	183
15/10/2020	0,050	0,025	Certa	15.441.478.000	0	183
15/04/2021	0,050	0,025	Certa	15.441.478.000	15.441.478.000	182

Annotazioni

Risultati asta:	
1a	100.00 4.000,000 mld 16/04/2018
2a	100.00 1.200,000 mld 16/04/2018
Risultati riaperture:	
Tranche	Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3a/4a	99.95 2.750,000 mld 15/05/2018
5a/6a	96.93 2.000 mld 15/06/2018
7a/8a	97.16 2.000 mld 16/07/2018
9a/10a	97.10 2.500 mld 17/09/2018