

CCTeu 15/03/18-09/25 (0.55 AT) / IT0005331878

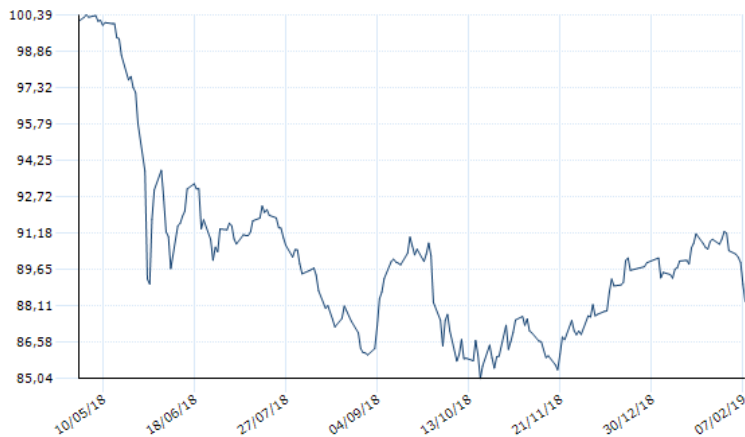
Grado di rischio calcolato

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
89,69 EUR	Republic of Italy	15/09/2025	0,141%	2,012%	1,968%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	89,69
Rendimento lordo	2,01166
Rendimento netto	1,96839
Cedola in corso	0,14100
Rateo lordo	0,11919
Rateo netto	0,10429
Vita residua	6,58630
Duration modificata	0,22377
Convessità	0,27384
Cedola successiva	0,16200
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	14.343.153.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/03/2018
Prezzo emissione	100,4000
Decorrenza prima cedola regolare	15/03/2018
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/09/2025
Data estinzione	15/09/2025
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	89,6900 EUR
Euro MTS	13/02/2019	89,0800 EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	89,2100 EUR
Euro TLX	13/02/2019	89,7400 EUR
Hi-MTF	13/02/2019	89,6815 EUR

Formula di indicizzazione

 $TV = (\text{Euribor } 6m + 0.55) \times \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg)}$

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/03/2019	0,281	0,141	Certa	14.343.153.000	0	181
15/09/2019	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	184
15/03/2020	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	182
15/09/2020	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	184
15/03/2021	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	181
15/09/2021	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	184
15/03/2022	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	181
15/09/2022	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	184
15/03/2023	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	181
15/09/2023	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	184
15/03/2024	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	182
15/09/2024	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	184
15/03/2025	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	0	181
15/09/2025	0,000	0,162	Prevista	14.343.153.000	14.343.153.000	184

Annotazioni

Risultati asta:
1/ 100.40 3.500 mld 02/05/2018
2a 100.40 1.500 mld 02/05/2018
Risultati riapertura:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 88.26 2.000 mld 01/06/2018
5/6a 90.50 2.000 mld 02/07/2018
7/8a 90.05 1.725 mld 01/08/2018
9/10a 86.75 754.700 mld 03/09/2018
11/12a 90.11 1.250.000 mld 01/10/2018
13/14a 86.91 1.000.000 mld 01/11/2018
15/16a 87.13 641.125 mld 03/12/2018
17/18a 90.25 750.000 mld 02/01/2019

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/03/2018	15/09/2025	EURIBOR6M	1,000	0,550