

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
100,28 EUR	Republic of Italy	01/12/2028	1,400%	2,783%	2,425%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,28
Rendimento lordo	2,78345
Rendimento netto	2,42494
Cedola in corso	1,40000
Rateo lordo	0,58462
Rateo netto	0,51154
Vita residua	9,80000
Duration modificata	8,35945
Convessità	84,23115
Cedola successiva	1,40000
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	18.824.192.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	01/08/2018
Prezzo emissione	99,5400
Decorrenza prima cedola regolare	01/12/2018
Data Prorata	01/08/2018
Tasso annuale	2,8000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/12/2028
Data estinzione	01/12/2028
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
Bayerische Börse	12/02/2019	99,4460	EUR
MOT	13/02/2019	100,2800	EUR
Euro MTS	13/02/2019	100,2700	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	99,7460	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,3400	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,0791	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/06/2019	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	182
01/12/2019	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/06/2020	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/12/2020	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/06/2021	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	182
01/12/2021	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/06/2022	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	182
01/12/2022	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/06/2023	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	182
01/12/2023	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/06/2024	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/12/2024	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/06/2025	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	182
01/12/2025	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/06/2026	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	182
01/12/2026	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/06/2027	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	182
01/12/2027	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/06/2028	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	0	183
01/12/2028	2,800	1,400	Certa	18.824.192.000	18.824.192.000	183

Annotazioni

Risultati asta:
1a 99.54 4.000,000 mld 01/08/2018
2a 99.54 998,796 mld 01/08/2018
Risultati riapertura:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3a/4a 96.35 2.750 mld 03/09/2018
5a/6a 99.31 2.000 mld 01/10/2018
7a/8a 95.46 2.500 mld 01/11/2018
9a/10a 96.52 2.250 mld 03/12/2018
11a/12a 101.04 1.511.350 mld 02/01/2019
13a/14a 101.86 2.500 mld 01/02/2019