

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
101,44 EUR	Republic of Italy	15/11/2025	1,250%	2,277%	1,961%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	101,44
Rendimento lordo	2,27684
Rendimento netto	1,96081
Cedola in corso	1,25000
Rateo lordo	0,63536
Rateo netto	0,55594
Vita residua	6,75342
Duration modificata	6,08886
Convessità	45,07605
Cedola successiva	1,25000
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	13.316.097.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	17/09/2018
Prezzo emissione	99,7900
Decorrenza prima cedola regolare	15/11/2018
Data Prorata	17/09/2018
Tasso annuale	2,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/11/2025
Data estinzione	15/11/2025
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
Bayerische Börse	12/02/2019	100,7110	EUR
MOT	13/02/2019	101,4400	EUR
Euro MTS	13/02/2019	101,4800	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	100,9580	EUR
Euro TLX	13/02/2019	101,4500	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	101,3638	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/05/2019	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	181
15/11/2019	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	184
15/05/2020	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	182
15/11/2020	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	184
15/05/2021	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	181
15/11/2021	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	184
15/05/2022	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	181
15/11/2022	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	184
15/05/2023	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	181
15/11/2023	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	184
15/05/2024	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	182
15/11/2024	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	184
15/05/2025	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	0	181
15/11/2025	2,500	1,250	Certa	13.316.097.000	13.316.097.000	184

Annotazioni

Risultati asta:
1a/2a 99.79 3.750 mld 17/09/2018
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3a/4a 95.23 1.500 mld 15/10/2018
5a/6a 96.24 1.750 mld 15/11/2018
7a/8a 101.02 2.250 mld 15/01/2019
9a/10a 101.59 2.250 mld 15/02/2019