

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Altamente liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
103,3 EUR	Republic of Italy	15/10/2021	1,150%	1,041%	0,736%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	103,3
Rendimento lordo	1,04093
Rendimento netto	0,73591
Cedola in corso	1,15000
Rateo lordo	0,77720
Rateo netto	0,68005
Vita residua	2,66575
Duration modificata	2,55687
Convessità	9,20975
Cedola successiva	1,15000
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	16.208.066.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/10/2018
Prezzo emissione	99,4500
Decorrenza prima cedola regolare	15/10/2018
Tasso annuale	2,3000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/10/2021
Data estinzione	15/10/2021
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
Bayerische Börse	12/02/2019	102,8330	EUR
MOT	13/02/2019	103,3000	EUR
Euro MTS	13/02/2019	103,2800	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	103,0200	EUR
Euro TLX	13/02/2019	103,2930	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	103,1149	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/04/2019	2,300	1,150	Certa	16.208.066.000	0	182
15/10/2019	2,300	1,150	Certa	16.208.066.000	0	183
15/04/2020	2,300	1,150	Certa	16.208.066.000	0	183
15/10/2020	2,300	1,150	Certa	16.208.066.000	0	183
15/04/2021	2,300	1,150	Certa	16.208.066.000	0	182
15/10/2021	2,300	1,150	Certa	16.208.066.000	16.208.066.000	183

Annotazioni

Risultati asta:
1/2a 99.45 3.500 mld 15/10/2018
Risultati riaperture:
Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
3/4a 100.94 2.500 mld 15/11/2018
5a 102.151 3.200 mld 13/12/2018
6a/7a 103.34 3.000 mld 15/01/2019
8a/9a 103.44 2.250 mld 15/02/2019