

CTZ 30/10/18-27/11/20 (1.626%) / IT0005350514

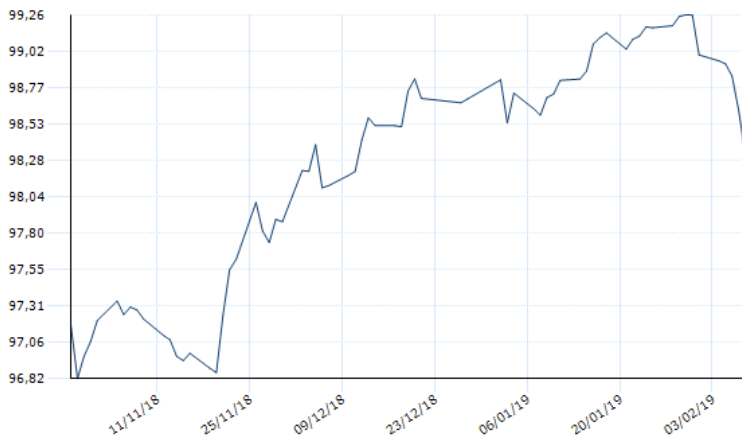
Grado di rischio calcolato

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
98,89 EUR	Republic of Italy	27/11/2020	0,000%	0,630%	0,430%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,886
Rendimento lordo	0,63007
Rendimento netto	0,43014
Cedola in corso	N/A
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	1,78356
Duration modificata	1,77239
Convessità	4,90268
Cedola successiva	N/A
Mercato di riferimento	MOT

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Italy
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Zero Coupon
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	11.200.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Prezzo Tel-quel
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	30/10/2018
Prezzo emissione	96,7010
Decorrenza prima cedola regolare	30/10/2018
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	27/11/2020
Data estinzione	27/11/2020
Base rateo capitale	Composta
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	98,8860	EUR
Euro MTS	13/02/2019	98,8720	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	98,7360	EUR
Euro TLX	13/02/2019	98,8860	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	98,8845	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
27/11/2020	0,000	0,000	Certa	11.200.000.000	11.200.000.000	759

Annotazioni

 Risultati asta:
 1a/2a 96.701 3.000 mld 30/10/2018

 Risultati riapertura:
 Tranche Prezzo Importo assegnato Data regolamento
 3a/4a 98.042 2.500 mld 29/11/2018
 5a/6a 98.683 2.000 mld 02/01/2019
 7a/8a 99.333 2.500 mld 29/01/2019