

REPUBLIC OF ITALY 5.375% 06/33 / US465410BG26
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
103,82 USD	Republic of Italy	15/06/2033	2,688%	5,059%	4,387%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	103,815
Rendimento lordo	5,05858
Rendimento netto	4,38727
Cedola in corso	2,68750
Rateo lordo	0,89583
Rateo netto	0,78385
Vita residua	14,33973
Duration modificata	9,68838
Convessità	125,22796
Cedola successiva	2,68750
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Italy
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	27/02/2003
Prezzo emissione	98,4360
Decorrenza prima cedola regolare	15/06/2003
Data Prorata	27/02/2003
Tasso annuale	5,3750
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/06/2033
Data estinzione	15/06/2033
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	117,5400	USD
EuroMOT	13/02/2019	104,2300	USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	103,8150	USD
Euro TLX	13/02/2019	104,5000	USD
Hi-MTF	13/02/2019	104,1750	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/06/2019	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	182
15/12/2019	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
15/06/2020	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
15/12/2020	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
15/06/2021	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	182
15/12/2021	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
15/06/2022	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	182
15/12/2022	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
15/06/2023	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	182
15/12/2023	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
15/06/2024	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
15/12/2024	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
15/06/2025	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	182
15/12/2025	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
15/06/2026	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	182
15/12/2026	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
15/06/2027	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	182
15/12/2027	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
15/06/2028	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	0	183
.....						
15/06/2033	5,375	2,688	Certa	2.000.000.000	2.000.000.000	182