

Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Molto liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
101,8 EUR	Republic of Italy	15/06/2020	2,000%	0,633%	0,388%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	101,8
Rendimento lordo	0,63294
Rendimento netto	0,38784
Cedola in corso	2,00000
Rateo lordo	1,34247
Rateo netto	1,17466
Vita residua	1,33151
Duration modificata	0,36160
Convessità	0,49236
Cedola successiva	2,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of Italy
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.500.000.000
Nominale obbligazione	10.000,00
Taglio minimo	10.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/06/2005
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	15/06/2005
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola minima %	2,00
Cedola massima %	7,00
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/06/2020
Data estinzione	15/06/2020
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
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	102,5000	EUR
Euro TLX	13/02/2019	101,8000	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	102,1550	EUR

Formula di indicizzazione

 $TV = (85\% * CMSEUR10a) \text{ (puntuale 2gg)}$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/06/2019	0,000	2,000	Certa	2.500.000.000	0	365
15/06/2020	0,000	2,000	Prevista	2.500.000.000	2.500.000.000	366

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/06/2005	15/06/2020	IRS10YEUR	0,850	0,000