

OAT Indexee CPI 1.30% 07/19 / FR0010850032
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
101,17 EUR	Republic of France	25/07/2019	1,300%	0,546%	0,371%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	101,169
Rendimento lordo	0,54618
Rendimento netto	0,37088
Cedola in corso	1,30000
Rateo lordo	0,73014
Rateo netto	0,63887
Vita residua	0,43836
Duration modificata	0,21619
Convessità	0,15463
Cedola successiva	N/A
Coefficiente di inflazione	1,09995
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Republic of France
Tipo obbligazione	Inflation Linked
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	4.818.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	25/07/2009
Prezzo emissione	98,9000
Decorrenza prima cedola regolare	25/07/2009
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	25/07/2019
Data estinzione	25/07/2019
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	Si
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 12,5%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	13/02/2019	101,1550	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	101,1700	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	101,1390	EUR
NYSE Euronext Paris	13/02/2019	102,9000	EUR
EuroMOT	13/02/2019	101,1770	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	101,1370	EUR
Euro TLX	13/02/2019	101,1690	EUR

Formula di indicizzazione

 OAT legato all'Inflazione Francese.
 $Cedole = 1.30 * VN * IRi/IR0$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
25/07/2019	0,000	1,300	Prevista	4.818.000.000	4.818.000.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
25/07/2009	25/07/2019	CPI Francia (ex tabacco)	1,000	0,000

Annotazioni

 Dove:
 VN : Valore nominale dell'obbligazione
 IR : Inflazione di Riferimento
 IR0 : Inflazione di Riferimento iniziale (118.13935)
 $IRi = IRm-3 + (d-1)/D * (IRm-2 - IRm-3)$
 m : mese di riferimento
 d : giorno di riferimento
 D : n. giorni del mese m

 $Rimborso = VN * Max [1; IRf/IR0]$
 IRf : Inflazione di Riferimento alla data di scadenza