

OAT Indexee Ei 1.10% 07/22 / FR0010899765
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
108,43 EUR	Republic of France	25/07/2022	1,100%	0,654%	0,491%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	108,431
Rendimento lordo	0,65376
Rendimento netto	0,49149
Cedola in corso	1,10000
Rateo lordo	0,61781
Rateo netto	0,54058
Vita residua	3,44110
Duration modificata	1,57101
Convessità	3,44950
Cedola successiva	1,10000
Coefficiente di inflazione	1,12707
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	4.023.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	25/07/2009
Prezzo emissione	97,2700
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	25/07/2022
Data estinzione	25/07/2022
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	108,3860	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	108,3700	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	108,3370	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	108,3650	EUR
NYSE Euronext Paris	13/02/2019	109,2900	EUR
EuroMOT	13/02/2019	108,4200	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	108,3240	EUR
Euro TLX	13/02/2019	108,4310	EUR

Formula di indicizzazione

 OAT legato all'Inflazione Europea.
 Cedole= 1.10 * VN * IRi/IR0

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
25/07/2019	0,000	1,100	Prevista	4.023.000.000	0	365
25/07/2020	0,000	1,100	Prevista	4.023.000.000	0	366
25/07/2021	0,000	1,100	Prevista	4.023.000.000	0	365
25/07/2022	0,000	1,100	Prevista	4.023.000.000	4.023.000.000	365

Annotazioni

 Dove:
 VN : Valore nominale dell'obbligazione
 IR : Inflazione di Riferimento
 IR0 : Inflazione di Riferimento iniziale (108.08645)
 IRi : $IR_{m-3} + (d-1)/D * (IR_{m-2} - IR_{m-3})$
 m : mese di riferimento
 d : giorno di riferimento
 D : n. giorni del mese m

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
25/07/2009	25/07/2022	CPI Euro (ex tabacco)	1,000	0,000

 Rimborso= $VN * \text{Max} [1; IR_f/IR_0]$
 IRf : Inflazione di Riferimento alla data di scadenza