

OAT Indexee Ei 0.25% 07/24 / FR0011427848
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
107,38 EUR	Republic of France	25/07/2024	0,250%	0,879%	0,813%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	107,38
Rendimento lordo	0,87930
Rendimento netto	0,81310
Cedola in corso	0,25000
Rateo lordo	0,14041
Rateo netto	0,12286
Vita residua	5,44384
Duration modificata	2,41233
Convessità	7,68971
Cedola successiva	0,25000
Coefficiente di inflazione	1,05545
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	5.490.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	25/07/2012
Prezzo emissione	96,8100
Decorrenza prima cedola regolare	25/07/2012
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	25/07/2024
Data estinzione	25/07/2024
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	107,3290	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	107,3300	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	107,2960	EUR
NYSE Euronext Paris	13/02/2019	109,5100	EUR
EuroMOT	13/02/2019	107,3900	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	107,2600	EUR
Euro TLX	13/02/2019	107,3800	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	107,4100	EUR

Formula di indicizzazione

 OAT legato all'Inflazione Europea.
 $Cedole = 0,25 * VN * IRI/IR0$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
25/07/2019	0,000	0,250	Prevista	5.490.000.000	0	365
25/07/2020	0,000	0,250	Prevista	5.490.000.000	0	366
25/07/2021	0,000	0,250	Prevista	5.490.000.000	0	365
25/07/2022	0,000	0,250	Prevista	5.490.000.000	0	365
25/07/2023	0,000	0,250	Prevista	5.490.000.000	0	365
25/07/2024	0,000	0,250	Prevista	5.490.000.000	5.490.000.000	366

Annotazioni

 Dove:
 VN : Valore nominale dell'obbligazione
 IR : Inflazione di Riferimento
 IR0 : Inflazione di Riferimento iniziale (115.42065)
 $IRi : IRm-3 + (d-1)/D * (IRm-2 - IRm-3)$
 m : mese di riferimento
 d : giorno di riferimento
 D : n. giorni del mese m

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

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
25/07/2012	25/07/2024	CPI Euro (ex tabacco)	1,000	0,000