

**OAT Indexee Ei 0.10% 07/47 / FR0013209871**
**Grado di rischio calcolato**

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

**Grado Liquidità**

Molto liquido

12/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
102,51 EUR	Republic of France	25/07/2047	0,100%	1,972%	1,959%


**Analisi**

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	102,51
Rendimento lordo	1,97182
Rendimento netto	1,95924
Cedola in corso	0,10000
Rateo lordo	0,05589
Rateo netto	0,04890
Vita residua	28,46027
Duration modificata	7,94380
Convessità	114,06366
Cedola successiva	0,10000
Coefficiente di inflazione	1,03697
Mercato di riferimento	Börse Berlin

**Dati anagrafici principali**

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

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	4.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	25/07/2016
Prezzo emissione	111,6280
Decorrenza prima cedola regolare	25/07/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	25/07/2047
Data estinzione	25/07/2047
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	12/02/2019	102,3400	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	102,3740	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	102,5100	EUR
NYSE Euronext Paris	13/02/2019	106,0000	EUR
EuroMOT	13/02/2019	102,8400	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	102,2910	EUR

**Formula di indicizzazione**

 OAT legato all'Inflazione Europea.  
 $Cedole = 0.10 * VN * IRi/IR0$ 
**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
25/07/2019	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2020	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	366
25/07/2021	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2022	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2023	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2024	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	366
25/07/2025	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2026	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2027	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2028	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	366
25/07/2029	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2030	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2031	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2032	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	366
25/07/2033	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2034	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2035	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
25/07/2036	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	366
25/07/2037	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	0	365
.....						
25/07/2047	0,100	0,100	Prevista	4.000.000.000	4.000.000.000	365

**Annotazioni**

Dove:  
 VN : Valore nominale dell'obbligazione  
 IR : Inflazione di Riferimento  
 IR0 : Inflazione di Riferimento iniziale (100.38861)  
 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
25/07/2016	25/07/2047	CPI Euro (ex tabacco)	1,000	0,000