

Rendimento Obbligazioni Specialistico

02 maggio 2016

Segnale operativo

Se da un lato pare che la situazione sui bancari italiani stia prendendo una piega più tranquilla, rispetto a quanto visto in questi primi mesi di terrore con il Bail-In, usciamo dal bond MPS 11/17 Bancoposta C&F. Il motivo? Molto semplicemente perché il bond in questione non sta più andando da nessuna parte. A livello di Credit Risk non è cambiato molto, e certo non è la paura (stando alla situazione attuale) di un default che detta le ragioni dell'uscita, ma ormai da settimane, dopo il recupero monstre dopo lo sfondone monstre, è inchiodato sempre sugli stessi prezzi.



Poiché a parte il rateo che corre, non pare in grado di dare particolare contributo al nostro portafoglio, ce ne liberiamo incassando comunque un performance positiva, grazie alle cedole incassate in questi mesi di permanenza in portafoglio.

Rendimento Obbligazioni Specialistico - Portafoglio Modello										Value Date 04/05/2016		
Bond Name	ISIN	Currency	Maturity	Op.Prx	Last.Prx	YTM	Nom.Value	Amn.Last	Coll.Cpn	Var%	%Weight	
Mps 11/17 Bancoposta C&F	IT0004739576	EUR	29/09/2017	105,040	101,201	2,29%	10.000	10.163,14	660,00	1,07%	10,75%	

Per cui, SELL Mps 11/17 Bancoposta C&F (IT0004739576) ai prezzi correnti di mercato.

Segue in giornata il report mensile con analisi curve e tassi e aggiornamento di portafoglio.