

RILEVAZIONI DEGLI INDICI DI RIFERIMENTO

Data decorrenza	IRS Interest Rate Swap 5 anni	IRS Interest Rate Swap 10 anni	Euribor Euro Interbank Offered Rate base 360 1 mese	Euribor Euro Interbank Offered Rate base 360 3 mesi	Euribor Euro Interbank Offered Rate base 360 6 mesi	Euribor Euro Interbank Offered Rate base 365 1 mese	Euribor Euro Interbank Offered Rate base 365 3 mesi	Euribor Euro Interbank Offered Rate base 365 6 mesi	Tasso BCE	Euribor Euro Interbank Offered Rate MMP base 360 3 mesi	Euribor Euro Interbank Offered Rate MMP base 365 3 mesi
01/09/2021	-0,350	-0,050	-0,559	-0,549	-0,529	-0,567	-0,557	-0,536	0,000	-0,547	-0,555
01/08/2021	-0,350	-0,060	-0,558	-0,544	-0,524	-0,566	-0,552	-0,531	0,000	-0,545	-0,553
01/07/2021	-0,230	0,130	-0,555	-0,541	-0,513	-0,563	-0,549	-0,520	0,000	-0,543	-0,551
01/06/2021	-0,260	0,140	-0,558	-0,543	-0,512	-0,566	-0,551	-0,519	0,000	-0,539	-0,547
01/05/2021	-0,240	0,150	-0,558	-0,536	-0,518	-0,566	-0,543	-0,525	0,000	-0,539	-0,546
01/04/2021	-0,310	0,080	-0,555	-0,540	-0,526	-0,563	-0,548	-0,526	0,000	-0,539	-0,546
01/03/2021	-0,270	0,080	-0,553	-0,538	-0,518	-0,561	-0,545	-0,525	0,000	-0,542	-0,550
01/02/2021	-0,430	-0,170	-0,571	-0,548	-0,531	-0,579	-0,556	-0,538	0,000	-0,547	-0,555
01/01/2021	-0,460	-0,260	-0,562	-0,541	-0,520	-0,570	-0,549	-0,527	0,000	-0,537	-0,544
01/12/2020	-0,450	-0,240	-0,546	-0,528	-0,507	-0,554	-0,535	-0,514	0,000	-0,520	-0,527
01/11/2020	-0,490	-0,280	-0,550	-0,515	-0,515	-0,558	-0,522	-0,522	0,000	-0,507	-0,514
01/10/2020	-0,430	-0,240	-0,523	-0,494	-0,474	-0,530	-0,501	-0,481	0,000	-0,490	-0,497
01/09/2020	-0,360	-0,130	-0,523	-0,477	-0,444	-0,530	-0,484	-0,450	0,000	-0,478	-0,485
01/08/2020	-0,400	-0,240	-0,519	-0,461	-0,399	-0,526	-0,467	-0,405	0,000	-0,440	-0,446
01/07/2020	-0,340	-0,170	-0,507	-0,413	-0,287	-0,514	-0,419	-0,291	0,000	-0,365	-0,370
01/06/2020	-0,270	-0,110	-0,461	-0,290	-0,142	-0,467	-0,294	-0,144	0,000	-0,269	-0,273
01/05/2020	-0,260	-0,080	-0,465	-0,261	-0,169	-0,471	-0,265	-0,171	0,000	-0,263	-0,267
01/04/2020	-0,260	-0,050	-0,436	-0,353	-0,280	-0,442	-0,358	-0,284	0,000	-0,423	-0,429
01/03/2020	-0,350	-0,130	-0,488	-0,425	-0,375	-0,495	-0,431	-0,380	0,000	-0,406	-0,412
01/02/2020	-0,280	-0,030	-0,458	-0,398	-0,337	-0,464	-0,404	-0,342	0,000	-0,390	-0,395
01/01/2020	-0,100	0,240	-0,447	-0,388	-0,325	-0,453	-0,393	-0,330	0,000	-0,396	-0,402

Descrizione degli Indici di riferimento

Indice di riferimento	Amministratore dell'Indice	Applicazione
IRS - Interest Rate Swap Lettera 5 anni	ICE Benchmark Administrator (ICE)	Indice di riferimento utilizzato per i mutui ipotecari a tasso fisso calcolato giornalmente, che indica il tasso di interesse medio al quale i principali istituti di credito europei stipulano swap a copertura del rischio di interesse. Il valore dell'indice è rilevato l'ultimo giorno lavorativo del mese sul quotidiano "Il Sole 24 Ore", con valuta il primo giorno del mese successivo.

RILEVAZIONI DEGLI INDICI DI RIFERIMENTO

Indice di riferimento	Amministratore dell'Indice	Applicazione
IRS - Interest Rate Swap Lettera 10 anni	ICE Benchmark Administrator (ICE)	Indice di riferimento utilizzato per i mutui ipotecari a tasso fisso calcolato giornalmente, che indica il tasso di interesse medio al quale i principali istituti di credito europei stipulano swap a copertura del rischio di interesse. Il valore dell'indice è rilevato l'ultimo giorno lavorativo del mese sul quotidiano "Il Sole 24 Ore", con valuta il primo giorno del mese successivo.
Euribor - Euro Interbank Offered Rate - base 360 - 1 mese	European Money Market Institute	Indice di riferimento, applicato ai prestiti interbancari in euro non garantiti, calcolato giornalmente come media semplice delle quotazioni rilevate su un campione di banche con elevato merito di credito selezionato periodicamente dalla European Banking Federation. Il valore dell'indice è rilevato l'ultimo giorno lavorativo del mese sul quotidiano "Il Sole 24 Ore", con valuta il primo giorno del mese successivo.
Euribor - Euro Interbank Offered Rate - base 360 - 3 mesi	European Money Market Institute	Indice di riferimento, applicato ai prestiti interbancari in euro non garantiti, calcolato giornalmente come media semplice delle quotazioni rilevate su un campione di banche con elevato merito di credito selezionato periodicamente dalla European Banking Federation. Il valore dell'indice è rilevato l'ultimo giorno lavorativo del mese sul quotidiano "Il Sole 24 Ore", con valuta il primo giorno del mese successivo.
Euribor - Euro Interbank Offered Rate - base 360 - 6 mesi	European Money Market Institute	Indice di riferimento, applicato ai prestiti interbancari in euro non garantiti, calcolato giornalmente come media semplice delle quotazioni rilevate su un campione di banche con elevato merito di credito selezionato periodicamente dalla European Banking Federation. Il valore dell'indice è rilevato l'ultimo giorno lavorativo del mese sul quotidiano "Il Sole 24 Ore", con valuta il primo giorno del mese successivo.
Euribor - Euro Interbank Offered Rate - base 365 - 1 mese	European Money Market Institute	Indice di riferimento, applicato ai prestiti interbancari in euro non garantiti, calcolato giornalmente come media semplice delle quotazioni rilevate su un campione di banche con elevato merito di credito selezionato periodicamente dalla European Banking Federation. Tasso risultante dalla moltiplicazione del tasso dell'indice di riferimento EURIBOR 360 per il coefficiente 365/360. Il valore dell'indice è rilevato l'ultimo giorno lavorativo del mese sul quotidiano "Il Sole 24 Ore", con valuta il primo giorno del mese successivo.
Euribor - Euro Interbank Offered Rate - base 365 - 3 mesi	European Money Market Institute	Indice di riferimento, applicato ai prestiti interbancari in euro non garantiti, calcolato giornalmente come media semplice delle quotazioni rilevate su un campione di banche con elevato merito di credito selezionato periodicamente dalla European Banking Federation. Tasso risultante dalla moltiplicazione del tasso dell'indice di riferimento EURIBOR 360 per il coefficiente 365/360. Il valore dell'indice è rilevato l'ultimo giorno lavorativo del mese sul quotidiano "Il Sole 24 Ore", con valuta il primo giorno del mese successivo.
Euribor - Euro Interbank Offered Rate - base 365 - 6 mesi	European Money Market Institute	Indice di riferimento, applicato ai prestiti interbancari in euro non garantiti, calcolato giornalmente come media semplice delle quotazioni rilevate su un campione di banche con elevato merito di credito selezionato periodicamente dalla European Banking Federation. Tasso risultante dalla moltiplicazione del tasso dell'indice di riferimento EURIBOR 360 per il coefficiente 365/360. Il valore dell'indice è rilevato l'ultimo giorno lavorativo del mese sul quotidiano "Il Sole 24 Ore", con valuta il primo giorno del mese successivo.
Euribor - Euro Interbank Offered Rate - MMP base 360 - 3 mesi	European Money Market Institute	Indice di riferimento, applicato ai prestiti interbancari in euro non garantiti, calcolato giornalmente come media semplice delle quotazioni rilevate su un campione di banche con elevato merito di credito selezionato periodicamente dalla European Banking Federation. Il valore dell'indice è rilevato l'ultimo giorno lavorativo del mese sul quotidiano "Il Sole 24 Ore", con valuta il primo giorno del mese successivo.
Euribor - Euro Interbank Offered Rate - MMP base 365 - 3 mesi	European Money Market Institute	Indice di riferimento, applicato ai prestiti interbancari in euro non garantiti, calcolato giornalmente come media semplice delle quotazioni rilevate su un campione di banche con elevato merito di credito selezionato periodicamente dalla European Banking Federation. Tasso risultante dalla moltiplicazione del tasso dell'indice di riferimento EURIBOR 360 per il coefficiente 365/360. Il valore dell'indice è rilevato l'ultimo giorno lavorativo del mese sul quotidiano "Il Sole 24 Ore", con valuta il primo giorno del mese successivo.