

**BNP PARIBAS 4.125% 01/22 / XS0635033631**
**Grado di rischio calcolato**

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

**Grado Liquidità**

Liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
111,32 EUR	BNP Paribas	14/01/2022	4,125%	0,221%	-0,798%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	111,32
Rendimento lordo	0,22092
Rendimento netto	-0,79800
Cedola in corso	4,12500
Rateo lordo	0,36164
Rateo netto	0,26762
Vita residua	2,91507
Duration modificata	2,79828
Convessità	10,79414
Cedola successiva	4,12500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	BNP Paribas
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	850.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	14/06/2011
Prezzo emissione	99,0390
Decorrenza prima cedola regolare	14/01/2012
Data Prorata	14/06/2011
Tasso annuale	4,1250
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	14/01/2022
Data estinzione	14/01/2022
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

**Mercati di quotazione**

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	13/02/2019	111,3200	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	111,3500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	111,3500	EUR
NYSE Euronext Paris	13/02/2019	119,8000	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	111,3500	EUR

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
14/01/2020	4,125	4,125	Certa	850.000.000	0	365
14/01/2021	4,125	4,125	Certa	850.000.000	0	366
14/01/2022	4,125	4,125	Certa	850.000.000	850.000.000	365