

BNP PARIBAS ARB. USD TF+TV 04/23 / XS1218967377
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
90,81 USD	BNP Paribas Arbitrage Issuance	27/04/2023	0,299%	3,612%	3,275%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	90,81
Rendimento lordo	3,61162
Rendimento netto	3,27540
Cedola in corso	0,29850
Rateo lordo	0,05970
Rateo netto	0,04418
Vita residua	4,19726
Duration modificata	0,06140
Convessità	0,06517
Cedola successiva	0,29900
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	BNP Paribas Arbitrage Issuance
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore Valuta
EuroMOT	13/02/2019	90,7500 USD
Euro TLX	13/02/2019	90,8100 USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	107.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	27/04/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	27/04/2015
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	27/04/2023
Data estinzione	27/04/2023
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso trimestrale dell'1.00%.
 Poi tassi variabili trimestrali così calcolati:
 $TV = (\text{Euribor } 3m + 1.50) / 4$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
27/04/2019	0,000	0,299	Certa	107.000.000	0	90
27/07/2019	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	91
27/10/2019	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	92
27/01/2020	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	92
27/04/2020	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	91
27/07/2020	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	91
27/10/2020	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	92
27/01/2021	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	92
27/04/2021	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	90
27/07/2021	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	91
27/10/2021	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	92
27/01/2022	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	92
27/04/2022	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	90
27/07/2022	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	91
27/10/2022	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	92
27/01/2023	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	0	92
27/04/2023	0,000	0,299	Prevista	107.000.000	107.000.000	90

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
27/04/2017	27/04/2023	EURIBOR3M	1,000	1,500