

SOCIETE GENERALE USD TF+TV 03/26 / XS1265944964
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
100,49 USD	Societe' Generale	03/03/2026	0,935%	3,707%	2,716%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,49
Rendimento lordo	3,70749
Rendimento netto	2,71551
Cedola in corso	0,93450
Rateo lordo	0,74760
Rateo netto	0,55322
Vita residua	7,04932
Duration modificata	0,26306
Convessità	0,33226
Cedola successiva	0,93400
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Societe' Generale
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	50.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	03/03/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	03/03/2016
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30/360
Cedola massima %	1,31
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	03/03/2026
Data estinzione	03/03/2026
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
EuroMOT	13/02/2019	100,4900	USD
Euro TLX	13/02/2019	100,4900	USD

Formula di indicizzazione

Primi 2 anni tasso fisso trimestrale dell'1,3125%.
 Poi tasso variabile trimestrale così calcolato:
 $TV = (\text{USDLibor } 3m + 1,00) / 4$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
03/03/2019	3,738	0,935	Certa	50.000.000	0	90
03/06/2019	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	92
03/09/2019	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	92
03/12/2019	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	91
03/03/2020	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	91
03/06/2020	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	92
03/09/2020	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	92
03/12/2020	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	91
03/03/2021	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	90
03/06/2021	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	92
03/09/2021	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	92
03/12/2021	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	91
03/03/2022	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	90
03/06/2022	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	92
03/09/2022	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	92
03/12/2022	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	91
03/03/2023	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	90
03/06/2023	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	92
03/09/2023	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	0	92
03/03/2026	0,000	0,934	Prevista	50.000.000	50.000.000	90

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
03/03/2018	03/03/2026	USDLIBOR3M	1,000	1,000