

SOCIETE GENERALE USDLib3m 03/26 / XS1265960739

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
94,86 USD	Societe' Generale	16/03/2026	0,697%	3,611%	2,860%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	94,86
Rendimento lordo	3,61107
Rendimento netto	2,86025
Cedola in corso	0,69700
Rateo lordo	0,44427
Rateo netto	0,32876
Vita residua	7,08493
Duration modificata	0,14158
Convessità	0,16162
Cedola successiva	0,68400
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	25.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	16/03/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	16/03/2016
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30/360
Cedola minima %	0,50
Cedola massima %	1,00
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	16/03/2026
Data estinzione	16/03/2026
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
EuroMOT	13/02/2019	94,8600	USD
Euro TLX	13/02/2019	94,8600	USD

Formula di indicizzazione
 $TV = (USDLibor\ 3m) / 4$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/03/2019	0,000	0,697	Certa	25.000.000	0	91
17/06/2019	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	91
16/09/2019	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	91
16/12/2019	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	91
16/03/2020	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	91
16/06/2020	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	92
16/09/2020	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	92
16/12/2020	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	91
16/03/2021	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	90
16/06/2021	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	92
16/09/2021	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	92
16/12/2021	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	91
16/03/2022	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	90
16/06/2022	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	92
16/09/2022	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	92
16/12/2022	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	91
16/03/2023	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	90
16/06/2023	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	92
18/09/2023	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	0	94
.....						
16/03/2026	0,000	0,684	Prevista	25.000.000	25.000.000	90

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call	Dal 16/03/2017	Ad ogni stacco cedola	100	5

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
16/03/2016	16/03/2026	USDLIBOR3M	1,000	0,000