

BNP PARIBAS ARB. USD TF+TV 09/25 / XS1289967298
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
83,43 USD	BNP Paribas Arbitrage Issuance	22/09/2025	0,123%	3,339%	3,193%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	83,43
Rendimento lordo	3,33863
Rendimento netto	3,19326
Cedola in corso	0,12250
Rateo lordo	0,07214
Rateo netto	0,05338
Vita residua	6,60548
Duration modificata	0,47570
Convessità	0,70199
Cedola successiva	0,12400
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	83,3700 USD
Euro TLX	13/02/2019	83,4300 USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	55.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	22/09/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	22/09/2015
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	22/09/2025
Data estinzione	22/09/2025
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 2 anni tasso fisso trimestrale dell'1,25%.
Poi tassi variabili trimestrali così calcolati:
TV= (Euribor 3m + 0.80)/4 (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
22/03/2019	0,000	0,123	Certa	55.000.000	0	90
22/06/2019	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	92
22/09/2019	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	92
22/12/2019	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	91
22/03/2020	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	91
22/06/2020	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	92
22/09/2020	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	92
22/12/2020	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	91
22/03/2021	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	90
22/06/2021	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	92
22/09/2021	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	92
22/12/2021	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	91
22/03/2022	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	90
22/06/2022	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	92
22/09/2022	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	92
22/12/2022	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	91
22/03/2023	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	90
22/06/2023	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	92
22/09/2023	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	0	92
.....						
22/09/2025	0,000	0,124	Prevista	55.000.000	55.000.000	92

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
22/09/2017	22/09/2025	EURIBOR3M	1,000	0,800