

BNP PARIBAS ARB. USD TF+TV 11/23 / XS1319787153
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
86,88 USD	BNP Paribas Arbitrage Issuance	25/11/2023	0,000%	2,984%	2,984%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	86,88
Rendimento lordo	2,98377
Rendimento netto	2,98377
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	4,77808
Duration modificata	0,56383
Convessità	0,88173
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	BNP Paribas Arbitrage Issuance
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore Valuta
EuroMOT	13/02/2019	86,8800 USD
Euro TLX	13/02/2019	86,8800 USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	10.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	25/11/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	25/11/2015
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	25/11/2023
Data estinzione	25/11/2023
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

Primo anno tasso fisso semestrale del 2.75%.
 Poi tassi variabili semestrali così calcolati:
 $TV = (5.50 - 2 * USDLIBOR 6m) / 2$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
25/05/2019	0,000	0,000	Certa	10.000.000	0	181
25/11/2019	0,000	0,000	Prevista	10.000.000	0	184
25/05/2020	0,000	0,000	Prevista	10.000.000	0	182
25/11/2020	0,000	0,000	Prevista	10.000.000	0	184
25/05/2021	0,000	0,000	Prevista	10.000.000	0	181
25/11/2021	0,000	0,000	Prevista	10.000.000	0	184
25/05/2022	0,000	0,000	Prevista	10.000.000	0	181
25/11/2022	0,000	0,000	Prevista	10.000.000	0	184
25/05/2023	0,000	0,000	Prevista	10.000.000	0	181
25/11/2023	0,000	0,000	Prevista	10.000.000	10.000.000	184

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
25/11/2016	25/11/2023	USDLIBOR6M	-2,000	5,500