

BNP PARIBAS ARBITR. 2.70% 03/26 / XS1365096087

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
92,92 USD	BNP Paribas Arbitrage Issuance	02/03/2026	2,700%	3,867%	3,133%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	92,92
Rendimento lordo	3,86700
Rendimento netto	3,13336
Cedola in corso	2,70000
Rateo lordo	2,57250
Rateo netto	1,90365
Vita residua	7,04658
Duration modificata	6,07734
Convessità	45,76560
Cedola successiva	2,70000
Mercato di riferimento	Euro TLX

## Dati anagrafici principali

Ente emittente	BNP Paribas Arbitrage Issuance
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

## Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
EuroMOT	13/02/2019	92,9200	USD
Euro TLX	13/02/2019	92,9200	USD

## Caratteristiche principali

Nominale circolante	10.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	29/02/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	02/03/2017
Data Prorata	29/02/2016
Tasso annuale	2,7000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	02/03/2026
Data estinzione	02/03/2026
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
02/03/2019	2,700	2,700	Certa	10.000.000	0	365
02/03/2020	2,700	2,700	Certa	10.000.000	0	366
02/03/2021	2,700	2,700	Certa	10.000.000	0	365
02/03/2022	2,700	2,700	Certa	10.000.000	0	365
02/03/2023	2,700	2,700	Certa	10.000.000	0	365
02/03/2024	2,700	2,700	Certa	10.000.000	0	366
02/03/2025	2,700	2,700	Certa	10.000.000	0	365
02/03/2026	2,700	2,700	Certa	10.000.000	10.000.000	365

## Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call	Dal 21/02/2022	Ad ogni stacco cedola	100	5