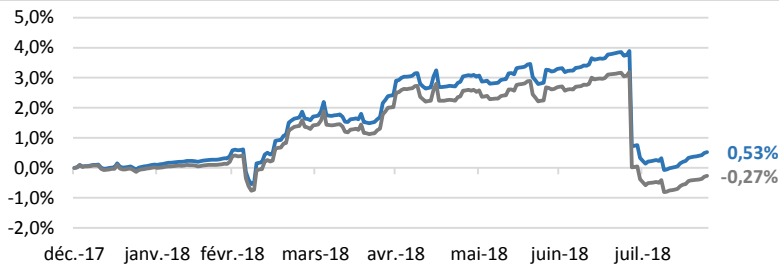




Tunisian Bond Index - TBI -

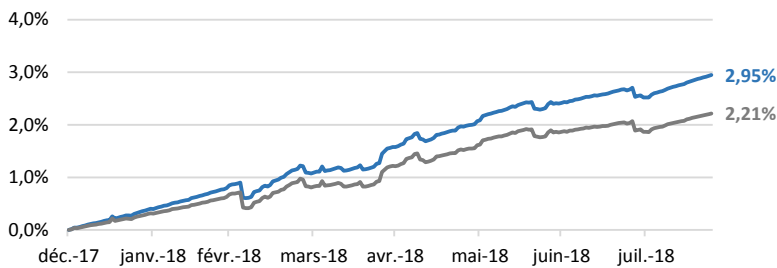
Vendredi 24 Août 2018

TBI Encours (Dt) = 12 979 852 115



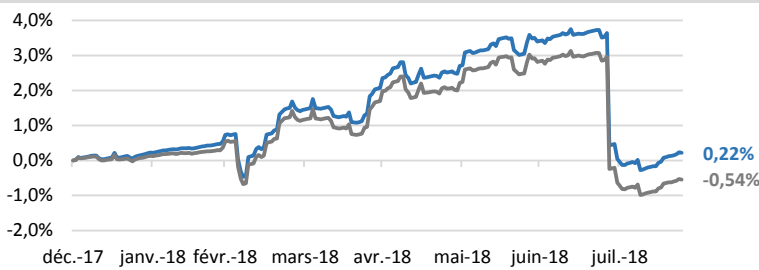
	Brut	Net
Indice	126,676	120,075
YTD	0,53%	-0,27%
YTD Annualisé	0,82%	-0,42%
Volatilité *	5,32%	5,35%
Taux Facial		5,84%
Taux Actuariel		7,79%
Sensibilité		3,39%
Duration		3,66
Maturité		4,52

TBI CT Encours (Dt) = 1 936 008 214



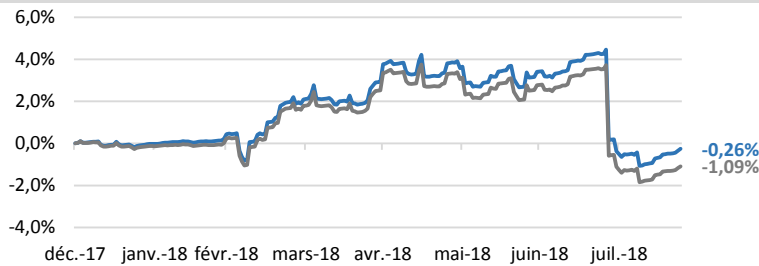
	Brut	Net
Indice	125,197	118,895
YTD	2,95%	2,21%
YTD Annualisé	4,60%	3,45%
Volatilité *	0,46%	0,46%
Taux Facial		4,24%
Taux Actuariel		5,54%
Sensibilité		0,25%
Duration		0,26
Maturité		0,26

TBI MT Encours (Dt) = 6 106 423 750



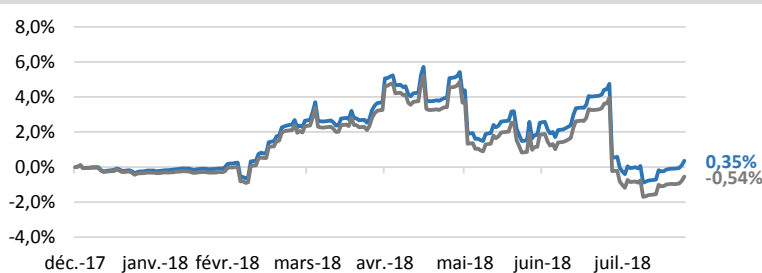
	Brut	Net
Indice	126,870	120,557
YTD	0,22%	-0,54%
YTD Annualisé	0,34%	-0,84%
Volatilité *	5,35%	5,37%
Taux Facial		5,90%
Taux Actuariel		8,19%
Sensibilité		2,63%
Duration		2,85
Maturité		3,14

TBI MLT Encours (Dt) = 4 510 853 786



	Brut	Net
Indice	127,246	120,351
YTD	-0,26%	-1,09%
YTD Annualisé	-0,40%	-1,68%
Volatilité *	7,42%	7,47%
Taux Facial		6,30%
Taux Actuariel		8,18%
Sensibilité		5,30%
Duration		5,73
Maturité		7,34

TBI LT Encours (Dt) = 426 566 365



	Brut	Net
Indice	111,976	107,740
YTD	0,35%	-0,54%
YTD Annualisé	0,55%	-0,83%
Volatilité *	9,33%	9,37%
Taux Facial		7,50%
Taux Actuariel		8,09%
Sensibilité		8,22%
Duration		8,89
Maturité		13,90

* Volatilité 90j annualisée des rendements de l'indice brut



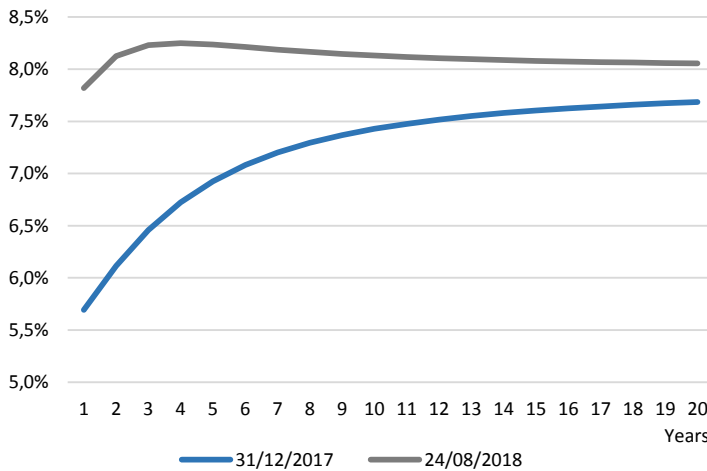
Tunisian Bond Index - TBI -

Vendredi 24 Août 2018

Détail des souches admises dans l'indice

Code ISIN	Type	Libelle	Nominal (DT)	Taux Facial	Date échéance	Encours	Strate
TN0008003717	BTC	BTC 26 semaines 04/09/2018	1 000		04/09/2018	1 200 000	CT
TN0008003899	BTC	BTC 13 Semaines 11/09/2018	1 000		11/09/2018	475 000 000	CT
TN0008003469	BTC	BTC 52 semaines 25/09/2018	1 000		25/09/2018	8 000 000	CT
TN0008000317	BTA	BTA 5.50% Octobre 2018	1 000	5,50%	12/10/2018	677 039 000	CT
TN0008003527	BTC	BTC 52 semaines 20/11/2018	1 000		20/11/2018	21 000 000	CT
TN0008003550	BTC	BTC 52 semaines 18/12/2018	1 000		18/12/2018	41 000 000	CT
TN0008003600	BTC	BTC 52 semaines 15/01/2019	1 000		15/01/2019	10 900 000	CT
TN0008003659	BTC	BTC 52 semaines 12/02/2019	1 000		12/02/2019	11 500 000	CT
TN0008000275	BTA	BTA 5.50% Mars 2019	1 000	5,50%	11/03/2019	648 400 000	CT
TN0008003709	BTC	BTC 52 semaines 12/03/2019	1 000		12/03/2019	1 200 000	CT
TN0008003923	BTC	BTC 52 Semaines 09/07/2019	1 000		09/07/2019	3 000 000	CT
TN0008000333	BTA	BTA 5.5% Février 2020	1 000	5,50%	12/02/2020	725 580 000	MT
TN0008000358	BTA	BTA 5.5% Octobre 2020	1 000	5,50%	14/10/2020	901 050 000	MT
TN0008000564	BTA	BTA 5.75% Janvier 2021	1 000	5,75%	13/01/2021	700 490 000	MT
TN0008000671	BTA	BTA 6% juin 2021	1 000	6,00%	14/06/2021	424 996 000	MT
TN0008000689	BTA	BTA 6,1% novembre 2021	1 000	6,10%	10/11/2021	376 700 000	MT
TN0008000614	BTA	BTA 6% Février 2022	1 000	6,00%	11/02/2022	733 300 000	MT
TN0008000226	BTA	BTA 6.9% Mai 2022	1 000	6,90%	09/05/2022	667 918 000	MT
TN0008000291	BTA	BTA 5.6% Aout 2022	1 000	5,60%	11/08/2022	704 875 000	MT
TN0008000572	BTA	BTA 6% Avril 2023	1 000	6,00%	13/04/2023	753 100 000	MT
TN0008000648	BTA	BTA 6% Juin 2023	1 000	6,00%	15/06/2023	328 099 000	MT
TN0008000630	BTA	BTA 6% Octobre 2023	1 000	6,00%	12/10/2023	735 780 000	MLT
TN0008000598	BTA	BTA 6% Janvier 2024	1 000	6,00%	12/01/2024	383 416 000	MLT
TN0008000366	BTA	BTA 6% Avril 2024	1 000	6,00%	10/04/2024	628 500 000	MLT
TN0008000705	BTA	BTA 6,5% juin 2025	1 000	6,50%	11/06/2025	36 200 000	MLT
TN0008000622	BTA	BTA 6.3% Mars 2026	1 000	6,30%	11/03/2026	804 008 000	MLT
TN0008000580	BTA	BTA 6.3% Octobre 2026	1 000	6,30%	14/10/2026	817 500 000	MLT
TN0008000655	BTA	BTA 6.6% Mars 2027	1 000	6,60%	29/03/2027	540 650 000	MLT
TN0008000606	BTA	BTA 6.7% Avril 2028	1 000	6,70%	13/04/2028	833 687 000	MLT
TN0008000697	BTA	BTA 7% juillet 2028	1 000	7,00%	10/07/2028	30 500 000	MLT
TN0008000663	BTA	BTA 7,5% Juillet 2032	1 000	7,50%	15/07/2032	444 200 000	LT

Evolution de la courbe des taux



Structure du TBI par strate

