

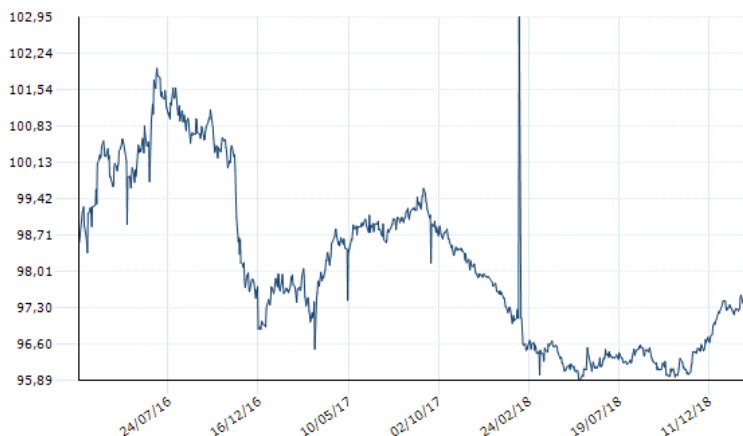
Grado di rischio calcolato

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
97,41 USD	European Investment Bank	15/06/2021	0,813%	2,800%	2,584%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,41
Rendimento lordo	2,80001
Rendimento netto	2,58372
Cedola in corso	0,81250
Rateo lordo	0,27083
Rateo netto	0,23698
Vita residua	2,33151
Duration modificata	2,22851
Convessità	7,19032
Cedola successiva	0,81250
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	European Investment Bank
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	3.500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	08/03/2016
Prezzo emissione	99,6790
Decorrenza prima cedola regolare	15/06/2016
Data Prorata	08/03/2016
Tasso annuale	1,6250
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/06/2021
Data estinzione	15/06/2021
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 12,5%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	13/02/2019	97,4100	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	97,7100	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	97,6800	USD
Börse Berlin	13/02/2019	97,7300	USD
EuroMOT	13/02/2019	97,7500	USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	97,6900	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	97,6700	USD
Euro TLX	13/02/2019	97,7400	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/06/2019	1,625	0,813	Certa	3.500.000.000	0	182
15/12/2019	1,625	0,813	Certa	3.500.000.000	0	183
15/06/2020	1,625	0,813	Certa	3.500.000.000	0	183
15/12/2020	1,625	0,813	Certa	3.500.000.000	0	183
15/06/2021	1,625	0,813	Certa	3.500.000.000	3.500.000.000	182