

ING BANK NV CMS30a 10/19 / XS0101698289

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 |
| 104,02 EUR | ING Bank | 04/10/2019 | 2,750% | -0,817% | -2,172% |


Analisi

| | |
|------------------------|------------|
| Data ultima quotazione | 13/02/2019 |
| Data valutazione | 13/02/2019 |
| Data valuta | 15/02/2019 |
| Prezzo | 104,02 |
| Rendimento lordo | -0,81733 |
| Rendimento netto | -2,17224 |
| Cedola in corso | 2,75000 |
| Rateo lordo | 2,02473 |
| Rateo netto | 1,49830 |
| Vita residua | 0,63288 |
| Duration modificata | 0,17029 |
| Convessità | 0,19929 |
| Cedola successiva | 2,75000 |
| Mercato di riferimento | Euro TLX |

Dati anagrafici principali

| | |
|-------------------|----------------------|
| Ente emittente | ING Bank |
| Tipo obbligazione | Interest Rate Linked |
| Tipo tasso | Tasso Variabile |
| Divisa | EUR |
| Convertibilità | Nessuno |

Caratteristiche principali

| | |
|----------------------------------|-------------|
| Nominale circolante | 200.000.000 |
| Nominale obbligazione | 1.000,00 |
| Taglio minimo | 1.000,00 |
| Corso | Secco |
| Sottoscrizione | Regular |
| Data emissione | 04/10/1999 |
| Prezzo emissione | 101,6000 |
| Decorrenza prima cedola regolare | 04/10/1999 |
| Frequenza cedola | 2 |
| Base rateo cedola | ACT/ACT |
| Cedola minima % | 2,75 |
| Subordinato | NO |

Rimborso

| | |
|-----------------------------|-----------------|
| Tipo ammortamento | Unica Soluzione |
| Data 1° rimborso | 04/10/2019 |
| Data estinzione | 04/10/2019 |
| Base rateo capitale | Lineare |
| Indicizzazione sul capitale | No |
| Opzione call | no |
| Opzione put | no |
| Prezzo di rimborso | 100,000 |
| Regime fiscale | Tassato 26% |

Mercati di quotazione

| Mercato | Data | Valore | Valuta |
|----------------------|------------|----------|--------|
| Frankfurter Börse | 13/02/2019 | 103,3380 | EUR |
| Börse Berlin | 13/02/2019 | 103,1990 | EUR |
| Bourse de Luxembourg | 13/02/2019 | 103,5800 | EUR |
| Euro TLX | 13/02/2019 | 104,0200 | EUR |

Formula di indicizzazione
 $TV = (82\% * CMSEUR30a) / 2$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

| Data flusso | Tasso annuo % | Val. cedola | Tipo cedola | Val. residuo | Val. ammortato | Giorni |
|-------------|---------------|-------------|-------------|--------------|----------------|--------|
| 04/04/2019 | 0,000 | 2,750 | Certa | 200.000.000 | 0 | 182 |
| 04/10/2019 | 0,000 | 2,750 | Prevista | 200.000.000 | 200.000.000 | 183 |

Indicizzazione cedole

| Da | A | Descrizione indice | Peso | Spread |
|------------|------------|--------------------|-------|--------|
| 04/10/1999 | 04/10/2019 | IRS30YEUR | 0,820 | 0,000 |