

EIB 1629/47 Cms10a-2a 06/20 / XS0220507023

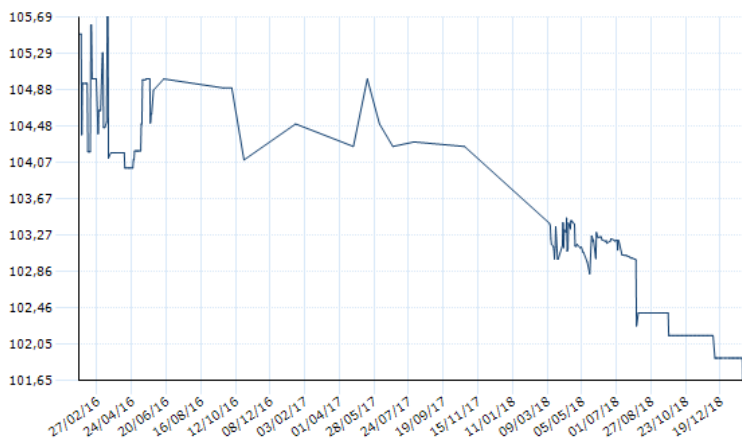
Grado di rischio calcolato

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
101,68 EUR	European Investment Bank	22/06/2020	1,500%	0,249%	0,065%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	101,68
Rendimento lordo	0,24917
Rendimento netto	0,06500
Cedola in corso	1,50000
Rateo lordo	0,97808
Rateo netto	0,85582
Vita residua	1,35068
Duration modificata	0,37648
Convessità	0,51822
Cedola successiva	1,50000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	European Investment Bank
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	13/02/2019	101,6800	EUR
MOT	13/02/2019	101,9410	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	102,4990	EUR

Caratteristiche principali

Nominale circolante	89.879.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	22/06/2005
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	22/06/2005
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola minima %	1,50
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	22/06/2020
Data estinzione	22/06/2020
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 12,5%

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
22/06/2019	0,000	1,500	Certa	89.879.000	0	365
22/06/2020	0,000	1,500	Prevista	89.879.000	89.879.000	366

Annotazioni

Primo anno tasso fisso del 6.00%. Poi:
 TV= (CMSEUR10a) (puntuale 2gg)
 con Cap: 5 * (CMSEUR10a - CMSEUR2a)