

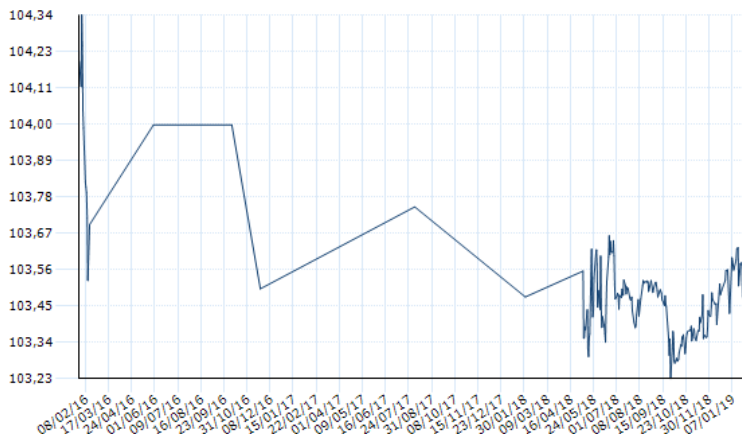
EIB 999/100 Global Floor 11/25 / XS0233286078
Grado di rischio calcolato

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
103,53 EUR	European Investment Bank	18/11/2025	0,927%	0,396%	0,283%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	103,528
Rendimento lordo	0,39637
Rendimento netto	0,28292
Cedola in corso	0,92700
Rateo lordo	0,22604
Rateo netto	0,19778
Vita residua	6,76164
Duration modificata	0,87217
Convessità	1,63286
Cedola successiva	0,92700
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	50.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	18/11/2005
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	18/11/2005
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	18/11/2025
Data estinzione	18/11/2025
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	102,6500	EUR
EuroMOT	13/02/2019	103,3900	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	103,5280	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/11/2019	0,000	0,927	Certa	50.000.000	0	365
18/11/2020	0,000	0,927	Prevista	50.000.000	0	366
18/11/2021	0,000	0,927	Prevista	50.000.000	0	365
18/11/2022	0,000	0,927	Prevista	50.000.000	0	365
18/11/2023	0,000	0,927	Prevista	50.000.000	0	365
18/11/2024	0,000	0,927	Prevista	50.000.000	0	366
18/11/2025	0,000	0,927	Prevista	50.000.000	50.000.000	365

Annotazioni

Primi tre anni tasso fisso annuo "Step-down". Poi:
 Cedola= VN * Max[CMSEUR10a; 5* (CMSEUR10a - CMSEUR2a)]
 (puntuale 2gg)
 Global Floor
 L'ultima cedola variabile sarà così calcolata:
 Cedola= VN * Max[0; 40,00% - Sommatoria cedole precedenti]