

LLOYDS TSB BANK PLC 5.375% 09/19 / XS0449361350

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
103,17 EUR	Lloyds TSB Bank	03/09/2019	5,375%	-0,383%	-1,701%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	103,17
Rendimento lordo	-0,38317
Rendimento netto	-1,70096
Cedola in corso	5,37500
Rateo lordo	2,42979
Rateo netto	1,79805
Vita residua	0,54795
Duration modificata	0,54678
Convessità	0,84638
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Lloyds TSB Bank
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.062.350.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	03/09/2009
Prezzo emissione	99,9170
Decorrenza prima cedola regolare	03/09/2009
Tasso annuale	5,3750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	03/09/2019
Data estinzione	03/09/2019
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	102,9900	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	102,9700	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	102,9700	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	102,9700	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	103,0580	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	102,9700	EUR
Euro TLX	13/02/2019	103,1700	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	103,0050	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
03/09/2019	5,375	5,375	Certa	1.062.350.000	1.062.350.000	365