

EIB Euribor3m 01/20 / XS0449594455

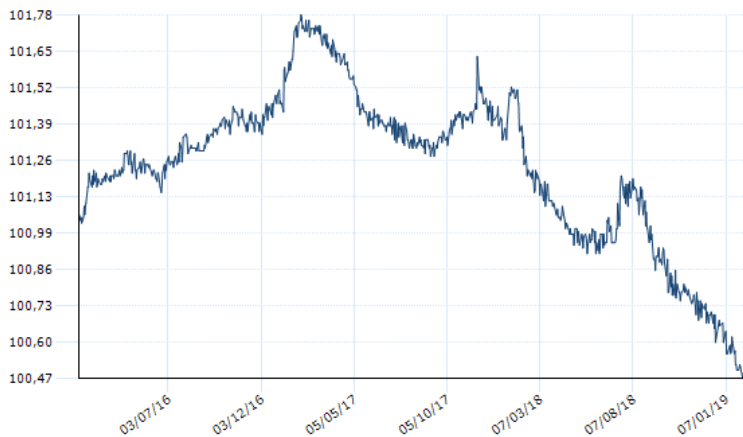
Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Grado Liquidità

Altamente liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
100,45 EUR	European Investment Bank	15/01/2020	0,000%	-0,483%	-0,486%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,45
Rendimento lordo	-0,48286
Rendimento netto	-0,48596
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	0,91507
Duration modificata	0,08344
Convessità	0,09040
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	European Investment Bank
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	03/09/2009
Prezzo emissione	99,7500
Decorrenza prima cedola regolare	03/09/2009
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/01/2020
Data estinzione	15/01/2020
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 12,5%

**Mercati di quotazione**

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	13/02/2019	100,4370	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,4200	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,4290	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	100,4400	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	100,4600	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,4290	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,4500	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,4900	EUR

**Formula di indicizzazione**

$$TV = (\text{Euribor } 3m + 0,175) * \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg)}$$
**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
04/03/2019	0,000	0,000	Certa	1.000.000.000	0	91
03/06/2019	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	0	91
03/09/2019	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	0	92
03/12/2019	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	0	91
15/01/2020	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	1.000.000.000	43

**Indicizzazione cedole**

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
03/09/2009	15/01/2020	EURIBOR3M	1,000	0,175