

**LLOYDS TSB BANK PLC 6.50% 09/40 / XS0543369184**
**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
153,01 GBP	Lloyds TSB Bank	17/09/2040	6,500%	3,093%	1,810%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	153,01
Rendimento lordo	3,09267
Rendimento netto	1,81026
Cedola in corso	6,50000
Rateo lordo	2,68904
Rateo netto	1,98989
Vita residua	21,60274
Duration modificata	13,36404
Convessità	245,02822
Cedola successiva	6,50000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	Lloyds TSB Bank
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	GBP
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	17/09/2010
Prezzo emissione	98,5170
Decorrenza prima cedola regolare	17/09/2010
Tasso annuale	6,5000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	17/09/2040
Data estinzione	17/09/2040
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	153,0100	GBP
Bayerische Börse	13/02/2019	153,0300	GBP
LSE London Stock Exchange	13/02/2019	153,9000	GBP
Börse Stuttgart	13/02/2019	152,9700	GBP

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
17/09/2019	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2020	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	366
17/09/2021	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2022	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2023	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2024	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	366
17/09/2025	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2026	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2027	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2028	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	366
17/09/2029	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2030	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2031	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2032	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	366
17/09/2033	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2034	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2035	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
17/09/2036	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	366
17/09/2037	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	0	365
.....						
17/09/2040	6,500	6,500	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	366