

EIB GBP 3.875% 06/37 / XS0740808802

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
131,16 GBP	European Investment Bank	08/06/2037	3,875%	1,851%	1,435%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	131,164
Rendimento lordo	1,85052
Rendimento netto	1,43481
Cedola in corso	3,87500
Rateo lordo	2,67534
Rateo netto	2,34092
Vita residua	18,32329
Duration modificata	13,61827
Convessità	234,14161
Cedola successiva	3,87500
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

Ente emittente	European Investment Bank
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	GBP
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	600.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	07/02/2012
Prezzo emissione	98,2830
Decorrenza prima cedola regolare	08/06/2012
Data Prorata	07/02/2012
Tasso annuale	3,8750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	08/06/2037
Data estinzione	08/06/2037
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	130,9800	GBP
Börse Düsseldorf	13/02/2019	130,9800	GBP
Bayerische Börse	13/02/2019	130,9900	GBP
EuroMOT	13/02/2019	131,3700	GBP
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	131,1640	GBP
Börse Stuttgart	13/02/2019	130,9800	GBP
Euro TLX	13/02/2019	131,2600	GBP
Hi-MTF	13/02/2019	131,2550	GBP

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
08/06/2019	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2020	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	366
08/06/2021	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2022	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2023	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2024	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	366
08/06/2025	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2026	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2027	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2028	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	366
08/06/2029	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2030	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2031	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2032	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	366
08/06/2033	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2034	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2035	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	365
08/06/2036	3,875	3,875	Certa	600.000.000	0	366
08/06/2037	3,875	3,875	Certa	600.000.000	600.000.000	365