

EIB Euribor3m 01/22 / XS0765766703

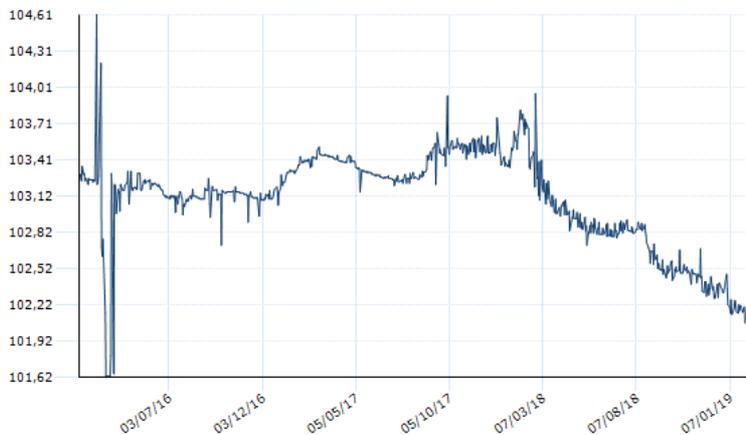
Grado di rischio calcolato

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
102,11 EUR	European Investment Bank	04/01/2022	0,048%	-0,524%	-0,549%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	102,11
Rendimento lordo	-0,52440
Rendimento netto	-0,54893
Cedola in corso	0,04750
Rateo lordo	0,02217
Rateo netto	0,01940
Vita residua	2,88767
Duration modificata	0,16986
Convessità	0,19871
Cedola successiva	0,05000
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	300.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	29/03/2012
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	04/07/2012
Data Prorata	29/03/2012
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	04/01/2022
Data estinzione	04/01/2022
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	102,0920	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	102,0300	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	102,0920	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	102,1160	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	102,0920	EUR
Euro TLX	13/02/2019	102,1100	EUR

Formula di indicizzazione

 $TV = (\text{Euribor } 3m + 0.50) * \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2gg)$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
04/04/2019	0,000	0,048	Certa	300.000.000	0	90
04/07/2019	0,000	0,050	Prevista	300.000.000	0	91
04/10/2019	0,000	0,050	Prevista	300.000.000	0	92
06/01/2020	0,000	0,050	Prevista	300.000.000	0	94
06/04/2020	0,000	0,050	Prevista	300.000.000	0	91
06/07/2020	0,000	0,050	Prevista	300.000.000	0	91
05/10/2020	0,000	0,050	Prevista	300.000.000	0	91
04/01/2021	0,000	0,050	Prevista	300.000.000	0	91
05/04/2021	0,000	0,050	Prevista	300.000.000	0	91
05/07/2021	0,000	0,050	Prevista	300.000.000	0	91
04/10/2021	0,000	0,050	Prevista	300.000.000	0	91
04/01/2022	0,000	0,050	Prevista	300.000.000	300.000.000	92

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
29/03/2012	04/01/2022	EURIBOR3M	1,000	0,500