

## 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
100,24 GBP	European Investment Bank	17/02/2020	0,284%	0,951%	0,802%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,24
Rendimento lordo	0,95068
Rendimento netto	0,80150
Cedola in corso	0,28390
Rateo lordo	0,27380
Rateo netto	0,23957
Vita residua	1,00548
Duration modificata	0,01076
Convessità	0,01088
Cedola successiva	0,29590
Mercato di riferimento	Euro TLX

## Dati anagrafici principali

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

## Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.875.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	17/02/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	17/02/2014
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/365
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	17/02/2020
Data estinzione	17/02/2020
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	100,2410	GBP
LSE London Stock Exchange	13/02/2019	100,2600	GBP
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	100,2600	GBP
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,2400	GBP
Euro TLX	13/02/2019	100,2400	GBP

## Formula di indicizzazione

$$TV = (GBPLibor3m + 0.25) \cdot \text{act}/365 \text{ (puntuale 2gg)}$$

## Flusso cedolare

Data	flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/02/2019	0,000	0,284	Certa	2.875.000.000	0	91	
17/05/2019	0,000	0,296	Prevista	2.875.000.000	0	88	
19/08/2019	0,000	0,296	Prevista	2.875.000.000	0	94	
18/11/2019	0,000	0,296	Prevista	2.875.000.000	0	91	
17/02/2020	0,000	0,296	Prevista	2.875.000.000	2.875.000.000	91	

## Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
17/02/2014	17/02/2020	GBPLIBOR3M	1,000	0,250