

EIB GBPLibor3m 05/21 / XS1068966073

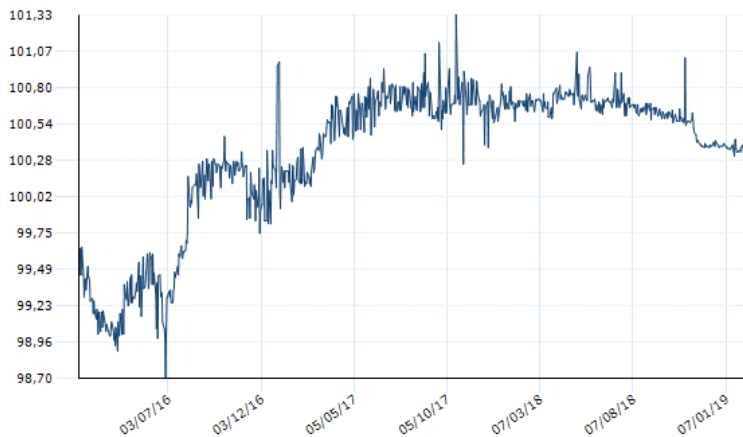
Grado di rischio calcolato

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
100,38 GBP	European Investment Bank	21/05/2021	0,274%	0,967%	0,825%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,38
Rendimento lordo	0,96732
Rendimento netto	0,82495
Cedola in corso	0,27430
Rateo lordo	0,25852
Rateo netto	0,22620
Vita residua	2,26301
Duration modificata	0,02639
Convessità	0,02708
Cedola successiva	0,28330
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	350.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	23/05/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	21/08/2014
Data Prorata	23/05/2014
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/365
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	21/05/2021
Data estinzione	21/05/2021
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	100,3660	GBP
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,3600	GBP
Bayerische Börse	13/02/2019	100,3760	GBP
Börse Berlin	13/02/2019	100,3670	GBP
LSE London Stock Exchange	13/02/2019	100,7500	GBP
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	100,4020	GBP
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,3500	GBP
Euro TLX	13/02/2019	100,3800	GBP

Formula di indicizzazione

$$TV = (\text{GBPLibor3m} + 0,20) \cdot \text{act}/365 \text{ (puntuale 2gg)}$$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
21/02/2019	0,000	0,274	Certa	350.000.000	0	92
21/05/2019	0,000	0,283	Prevista	350.000.000	0	89
21/08/2019	0,000	0,283	Prevista	350.000.000	0	92
21/11/2019	0,000	0,283	Prevista	350.000.000	0	92
21/02/2020	0,000	0,283	Prevista	350.000.000	0	92
21/05/2020	0,000	0,283	Prevista	350.000.000	0	90
21/08/2020	0,000	0,283	Prevista	350.000.000	0	92
23/11/2020	0,000	0,283	Prevista	350.000.000	0	94
22/02/2021	0,000	0,283	Prevista	350.000.000	0	91
21/05/2021	0,000	0,283	Prevista	350.000.000	350.000.000	88

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
23/05/2014	21/05/2021	GBPLIBOR3M	1,000	0,200