

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
102,28 EUR	European Investment Bank	15/07/2024	0,000%	-0,415%	-0,415%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	102,28
Rendimento lordo	-0,41535
Rendimento netto	-0,41535
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	5,41644
Duration modificata	0,16423
Convessità	0,19120
Cedola successiva	0,00000
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	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	06/11/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	15/01/2015
Data Prorata	06/11/2014
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/07/2024
Data estinzione	15/07/2024
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	102,1000	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	102,1000	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	102,1380	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	102,1600	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	102,4230	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	102,1370	EUR
Euro TLX	13/02/2019	102,2800	EUR

Formula di indicizzazione

 $TV = (\text{Euribor } 3m + 0,01) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2gg)$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/04/2019	0,000	0,000	Certa	500.000.000	0	90
15/07/2019	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	91
15/10/2019	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	92
15/01/2020	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	92
15/04/2020	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	91
15/07/2020	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	91
15/10/2020	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	92
15/01/2021	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	92
15/04/2021	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	90
15/07/2021	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	91
15/10/2021	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	92
17/01/2022	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	94
15/04/2022	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	88
15/07/2022	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	91
17/10/2022	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	94
16/01/2023	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	91
17/04/2023	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	91
17/07/2023	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	91
16/10/2023	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	0	91
.....						
15/07/2024	0,000	0,000	Prevista	500.000.000	500.000.000	91

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
06/11/2014	15/07/2024	EURIBOR3M	1,000	0,010