

EIB USD TF+USDLibor3m 02/24 / XS1551882860

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
94,92 USD	European Investment Bank	16/02/2024	0,425%	3,135%	2,872%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	94,92
Rendimento lordo	3,13452
Rendimento netto	2,87173
Cedola in corso	0,42500
Rateo lordo	0,42028
Rateo netto	0,36774
Vita residua	5,00548
Duration modificata	0,13734
Convessità	0,15620
Cedola successiva	0,50000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	European Investment Bank
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Euro TLX	13/02/2019	94,9200	USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	296.186.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	16/02/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	16/02/2017
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30/360
Cedola massima %	0,50
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	16/02/2024
Data estinzione	16/02/2024
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 12,5%

Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso trimestrale dello 0.425% annuo.

Poi:

 $TV = (USDLibor\ 3m + 0.25) / 4$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
16/02/2019	1,700	0,425	Certa	296.186.000	0	92
16/05/2019	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	89
16/08/2019	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/11/2019	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/02/2020	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/05/2020	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	90
16/08/2020	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/11/2020	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/02/2021	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/05/2021	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	89
16/08/2021	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/11/2021	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/02/2022	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/05/2022	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	89
16/08/2022	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/11/2022	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/02/2023	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/05/2023	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	89
16/08/2023	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	0	92
16/02/2024	0,000	0,500	Prevista	296.186.000	296.186.000	92

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
16/02/2019	16/02/2024	USDLIBOR3M	1,000	0,250