

Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Grado Liquidità

Liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
100,02 USD	European Investment Bank	27/01/2020	0,701%	2,854%	2,492%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,02
Rendimento lordo	2,85436
Rendimento netto	2,49184
Cedola in corso	0,70110
Rateo lordo	0,13869
Rateo netto	0,12135
Vita residua	0,94795
Duration modificata	0,19508
Convessità	0,23313
Cedola successiva	0,72480
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	27/01/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	27/01/2017
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	27/01/2020
Data estinzione	27/01/2020
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
Börse Berlin	12/02/2019	100,0760	USD
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	100,1330	USD
Euro TLX	13/02/2019	100,0200	USD

Formula di indicizzazione

$$TV = (\text{USDLibor3m} + 0.10) * \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg)}$$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
29/04/2019	0,000	0,701	Certa	500.000.000	0	91
29/07/2019	0,000	0,725	Prevista	500.000.000	0	91
28/10/2019	0,000	0,725	Prevista	500.000.000	0	91
27/01/2020	0,000	0,725	Prevista	500.000.000	500.000.000	91

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
27/01/2017	27/01/2020	USDLIBOR3M	1,000	0,100