

XS2616399395 AIIB 04-05-43 ZC

Asian Infrastructure Investment Bank

Divisa

MXN

Scadenza

04-05-2043

Prezzo

14.32

Rendimento Lordo

10.24

Rendimento Netto

9.63

Anagrafica

Debito	Senior
Categoria	Sovranazionale
Paese	Sovranazionale
Divisa	Peso Messicano
Capitale circolante	2,000,000,000
Lotto minimo	100,000
Prezzo emissione	15.00014
Data emissione	04-05-2023
Data scadenza	04-05-2043
Corso	TelQuel
Aliquota Tassazione	12.5%
Quotazione	EuroMot

Rimborso

Tipo rimborso	Unica soluzione
Prezzo indicizzato	No
Prezzo rimborso	100
Call/Put	No

Interessi

Cedola	ZeroCoupon
Tipo Rateo	30 / 360e
Calcolo interessi	Composto Giornaliero

Dati Calcolati

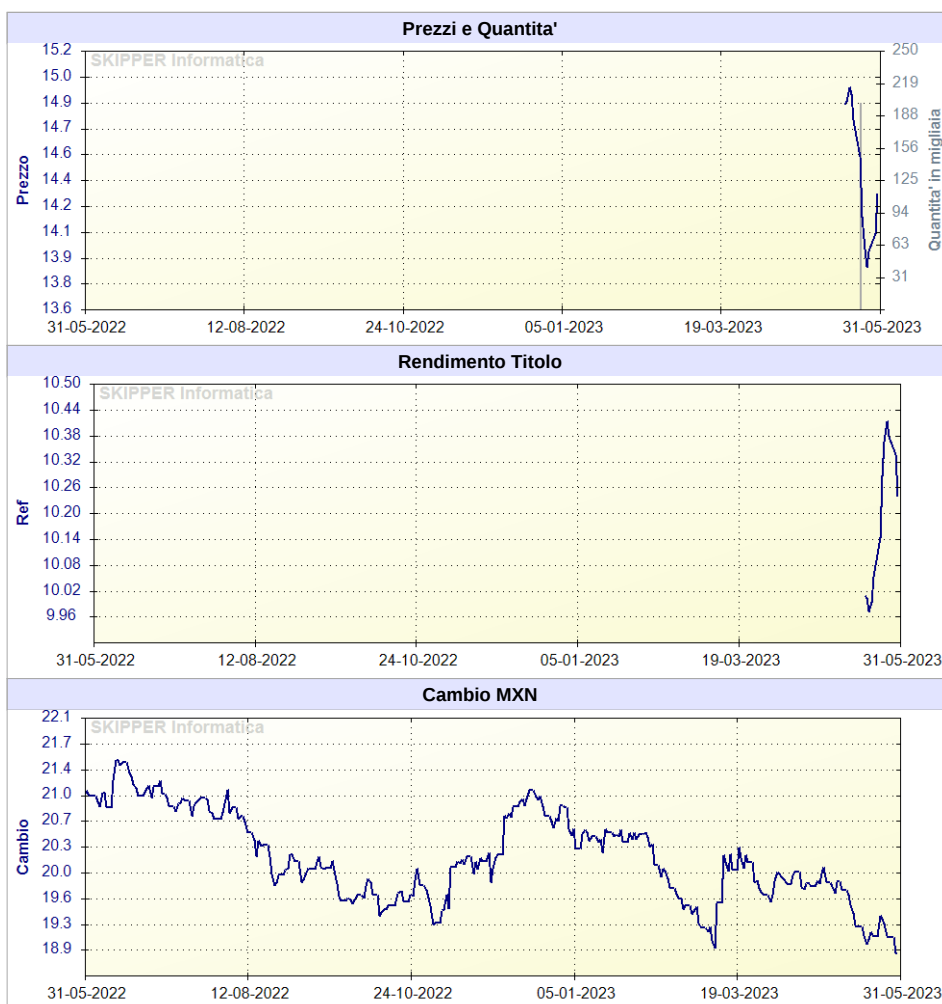
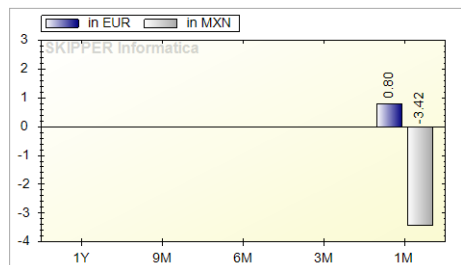
Data prezzo	30-05-2023
Data valuta	01-06-2023
Mercato	EuroMot
Prezzo	14.32
Rendimento Lordo	10.24
Rendimento Netto	9.63
Duration Lorda	19.94
Modified Duration Lorda	18.09
(1) PPS %	-6.17*
VaR 99% , 10 gg.	5.80*

Cash Flow lordo di 100,000 MXN

Data	Cedole	Rimborsi	Totale
04-05-2043		100,000.00	100,000.00
TOTALE	0.00	100,000.00	100,000.00

Performance di Periodo

	1Y	9M	6M	3M	1M
in EUR	-	-	-	-	0.80
in MXN	-	-	-	-	-3.42



(1) PPS : Peggior Performance Settimanale rilevata nell'ultimo anno solare.

* La presenza di un asterisco dopo un valore indica che, non avendo il titolo una serie storica di prezzi sufficiente, il calcolo e' stato effettuato utilizzando un'altra obbligazione avente le stesse caratteristiche.

XS2616399395 AIIB 04-05-43 ZC

Asian Infrastructure Investment Bank

SINTESI DESCRITTIVA

Serie: 00114^

1 - Importo e tipologia

Il prestito obbligazionario "Asian Infrastructure Investment Bank" di tipo Sovranazionale ha un capitale nominale circolante di MXN 2,000,000,000 con un lotto minimo iniziale di MXN 100,000.

2 - Data di godimento

La data di inizio maturazione interessi e' il 04-05-2023.

3 - Data e prezzo di emissione

Le obbligazioni del presente prestito sono emesse in data 04-05-2023 al prezzo di 15.00014.

4 - Durata

La durata del prestito obbligazionario all'emissione è di 20 anni dal 04-05-2023 al 04-05-2043.

5 - Modalita' di rimborso e scadenza

Le obbligazioni saranno rimborsate in un'unica soluzione alla pari.

La data di scadenza del prestito obbligazionario e' il 04-05-2043.

Non e' previsto il rimborso anticipato.

6 - Interessi

Il titolo e' uno Zerocoupon i cui interessi sono dati dalla differenza tra il prezzo di emissione e quello di rimborso.

Il tipo di calcolo del rateo e': 30 / 360e

7 - Quotazione

Il titolo risulta quotato sui seguenti mercati: EuroMot.

8 - Regime Fiscale

Il titolo e' soggetto al regime di Imposta Sostitutiva con un'aliquota di tassazione del 12.5%.

SEZIONE RISCHI

Modified Duration	18.09%	È una stima della perdita percentuale del valore del titolo a fronte di un aumento di un punto percentuale dei tassi di interesse di mercato.
PPS	-6.17*%	Peggior Performance Settimanale: rappresenta in percentuale la maggiore perdita settimanale del titolo nell'arco dell'ultimo anno solare con l'indicazione della data in cui è avvenuta.
VaR 99% , 10 gg.	5.80*%	Value at Risk: il calcolo del VAR (Price Var) è effettuato sulla base dei prezzi storici dell'obbligazione ed è calcolato con un grado di confidenza del 99% ed un orizzonte temporale di 10 giorni tenendo conto dell'eventuale Rischio Cambio.

* La presenza di un asterisco dopo un valore indica che, non avendo il titolo una serie storica di prezzi sufficiente, il calcolo è stato effettuato utilizzando un'altra obbligazione avente le stesse caratteristiche.

Rischio d'interesse: Un eventuale aumento dei tassi di interesse di mercato può comportare una diminuzione del prezzo del titolo mentre una diminuzione dei tassi può, al contrario, determinarne un rialzo. Il rischio è tanto maggiore quanto più alta è la duration del titolo. Le obbligazioni indicizzate, per loro natura e nella misura in cui adeguano nel tempo i propri flussi futuri ai tassi di mercato, sono meno reattive rispetto a titoli aventi flussi futuri predeterminati.

Rischio di credito: L'investimento in titoli di debito espone l'investitore alla possibilità che l'emittente non sia in grado di onorare i propri impegni in materia di pagamenti degli interessi e/o di rimborso del capitale. Più risulta elevato il rischio di credito e più elevato sarà il rendimento effettivo a scadenza richiesto dall'acquirente del titolo come compenso per la maggior esposizione al rischio.

Rischio di liquidità: Ogni investimento deve essere considerato anche sotto il profilo della maggiore o minore facilità di smobilizzo in tempi rapidi e a costi accettabili. Il rischio di liquidità è più alto se il titolo non è quotato su mercati organizzati. Inoltre, a fronte di un basso ammontare in circolazione, l'investitore può avere difficoltà a liquidare l'obbligazione.

Rischio di cambio: Qualora uno strumento finanziario sia denominato in una divisa diversa da quella di riferimento per l'investitore (tipicamente l'euro per l'investitore italiano) al fine di valutare la rischiosità complessiva dell'investimento occorre tenere presente la volatilità del rapporto di cambio.

Rischio "bail-in": Rischio connesso alle regole previste dalla Direttiva europea in tema di risanamento e risoluzione degli enti creditizi (Banking Resolution and Recovery Directive o "BRRD"). Con l'applicazione del "bail-in" gli obbligazionisti sono esposti al rischio di veder svalutato, azzerato, ovvero convertito in titoli di capitale il proprio investimento anche in assenza di una formale dichiarazione di insolvenza dell'Emittente.