

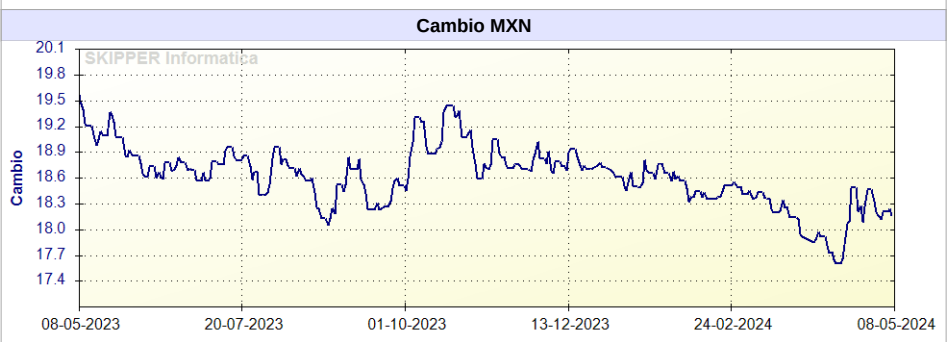
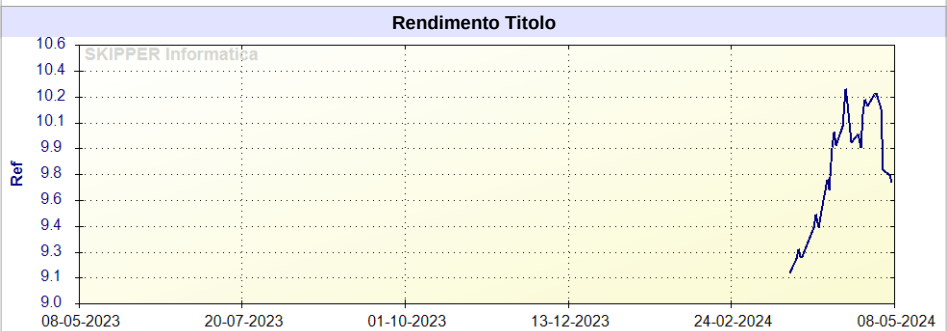
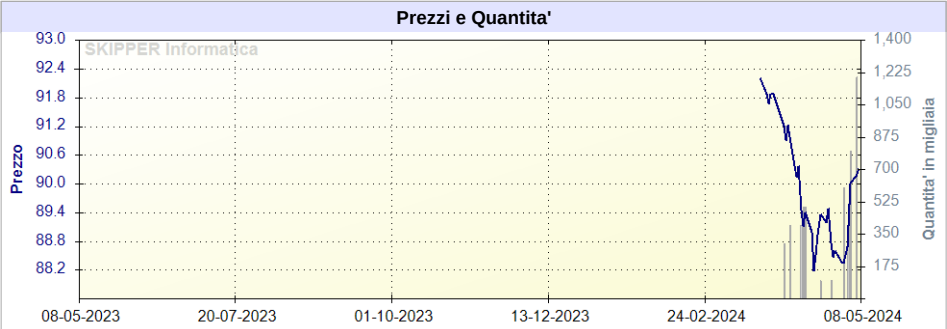
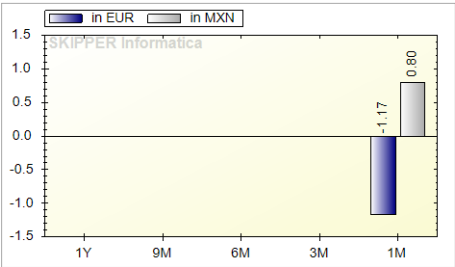
XS2017796694 BIRS 26-06-29 7.07%	Banca Internazionale per la Ricostruzione e lo Sviluppo - The World Bank Group
----------------------------------	--

Divisa	Scadenza	ESG	Prezzo	Rendimento Lordo	Rendimento Netto
MXN	26-06-2029	Green	90.31	9.71	8.73

Anagrafica		Rimborso		Dati Calcolati	
Debito	Senior	Tipo rimborso	Unica soluzione	Data prezzo	07-05-2024
Categoria	Sovranazionale	Prezzo indicizzato	No	Data valuta	09-05-2024
Paese	Sovranazionale	Prezzo rimborso	100	Rateo cedola	2.61197
Divisa	Peso Messicano	Call/Put	No	Mercato	EuroMot
Capitale circolante	1,920,000,000			Prezzo	90.31
Lotto minimo	100,000			Rendimento Lordo	9.71
Prezzo emissione	100			Rendimento Netto	8.73
Data emissione	26-06-2019	Interessi		Rend. Netto Capital Gain	8.52
Data scadenza	26-06-2029	Cedola	Fissa	Duration Lorda	4.23
Corso	Secco	Frequenza	Semestrale	Modified Duration Lorda	3.86
Aliquota Tassazione	12.5%	Tipo Rateo	30E/360 (30/360 ISMA)	(1) PPS %	-5.06*
Quotazione	EuroMot	Tasso annuo %	7.07	VaR 99% , 10 gg.	5.73*

Cash Flow lordo di 100,000 MXN			
Data	Cedole	Rimborsi	Totale
26-06-2024	3,535.00		3,535.00
26-12-2024	3,535.00		3,535.00
26-06-2025	3,535.00		3,535.00
26-12-2025	3,535.00		3,535.00
26-06-2026	3,535.00		3,535.00
26-12-2026	3,535.00		3,535.00
26-06-2027	3,535.00		3,535.00
26-12-2027	3,535.00		3,535.00
26-06-2028	3,535.00		3,535.00
26-12-2028	3,535.00		3,535.00
26-06-2029	3,535.00	100,000.00	103,535.00
TOTALE	38,885.00	100,000.00	138,885.00

Performance di Periodo					
	1Y	9M	6M	3M	1M
in EUR	-	-	-	-	-1.17
in MXN	-	-	-	-	0.80



Il calcolo del rendimento e' sempre espresso su base annua.
(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.

XS2017796694 BIRS 26-06-29 7.07%

Banca Internazionale per la Ricostruzione e lo Sviluppo - The World Bank Group

SINTESI DESCRITTIVA

Serie: "100836^ ESG-Green Bond"

1 - Importo e tipologia

Il prestito obbligazionario "Banca Internazionale per la Ricostruzione e lo Sviluppo - The World Bank Group" di tipo Sovranazionale, avente tasso annuo pari a 7.07%, ha un capitale nominale circolante di MXN 1,920,000,000 con un lotto minimo di MXN 100,000.

2 - Data di godimento

La data di inizio maturazione interessi e' il 26-06-2019.

3 - Data e prezzo di emissione

Le obbligazioni del presente prestito sono emesse in data 26-06-2019 alla pari.

4 - Durata

La durata del prestito obbligazionario all'emissione è di 10 anni dal 26-06-2019 al 26-06-2029.

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 26-06-2029.

Non e' previsto il rimborso anticipato.

6 - Interessi

Il titolo paga cedole Fisse.

La data di pagamento della prima cedola e' il 26-12-2019.

Il tasso annuo del titolo e' 7.07%.

Le cedole verranno pagate con frequenza Semestrale alle seguenti date di stacco: 26-06,26-12

Il tipo di calcolo del rateo e': 30E/360 (30/360 ISMA)

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%.

XS2017796694 BIRS 26-06-29 7.07%

Banca Internazionale per la Ricostruzione e lo Sviluppo - The World Bank Group

Prezzi listino EuroMot del 07-05-2024

SEZIONE RISCHI

Modified Duration	3.86%	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	-5.06**%	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.	5.73**%	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.