

B.IMI CMSEUR10a TF+TV 01/26 / IT0005139966

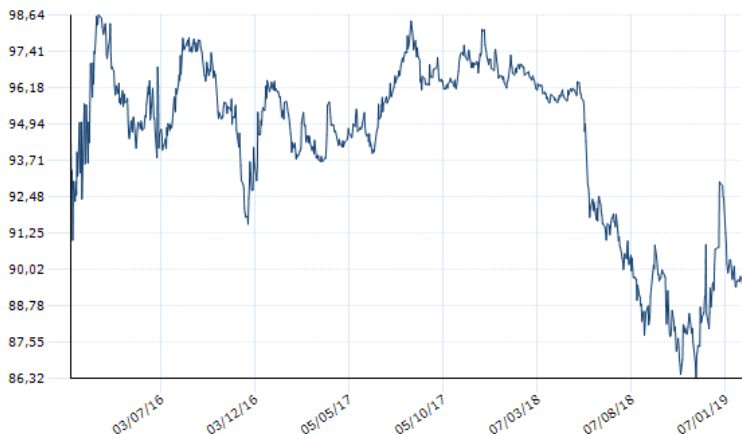
## Grado di rischio calcolato

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
89,3 EUR	Banca IMI	20/01/2026	0,544%	2,185%	2,045%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	89,3
Rendimento lordo	2,18548
Rendimento netto	2,04502
Cedola in corso	0,54370
Rateo lordo	0,03873
Rateo netto	0,02866
Vita residua	6,93425
Duration modificata	0,57351
Convessità	0,90242
Cedola successiva	0,50000
Mercato di riferimento	Euro TLX

## Dati anagrafici principali

Ente emittente	Banca IMI
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

## Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Euro TLX	13/02/2019	89,3000	EUR

## Caratteristiche principali

Nominale circolante	149.043.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	20/01/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	20/01/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola minima %	0,50
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	20/01/2026
Data estinzione	20/01/2026
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

## Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso del 2,00%.  
Poi cedole variabili annuali così calcolate:  
TV= (69% \* CMSEUR10a) (puntuale 2gg)

## Flusso cedolare

Data	flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
20/01/2020	0,000	0,544	Certa	149.043.000	0	365	
20/01/2021	0,000	0,500	Prevista	149.043.000	0	366	
20/01/2022	0,000	0,500	Prevista	149.043.000	0	365	
20/01/2023	0,000	0,500	Prevista	149.043.000	0	365	
20/01/2024	0,000	0,500	Prevista	149.043.000	0	365	
20/01/2025	0,000	0,500	Prevista	149.043.000	0	366	
20/01/2026	0,000	0,500	Prevista	149.043.000	149.043.000	365	

## Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
14/05/2017	14/05/2022	IRS10YEUR	0,690	0,000