

BANCO BPM 548a TF+TV 01/21 / IT0005158677

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
96,48 EUR	Banco BPM	29/01/2021	0,023%	1,948%	1,922%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	96,48
Rendimento lordo	1,94775
Rendimento netto	1,92200
Cedola in corso	0,02330
Rateo lordo	0,00413
Rateo netto	0,00306
Vita residua	1,95616
Duration modificata	0,15452
Convessità	0,17839
Cedola successiva	0,02400
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	999.790.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	29/01/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	29/01/2016
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30E/360
Cedola massima %	1,00
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	29/01/2021
Data estinzione	29/01/2021
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore Valuta
Börse Stuttgart	13/02/2019	96,1500 EUR
Euro TLX	13/02/2019	96,4800 EUR

Formula di indicizzazione

 Primi 2 anni tasso fisso trimestrale dello 0.625%. Poi:
 $TV = (\text{Euribor } 3m(\text{act}/360) + 0.40)/4$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
29/04/2019	0,093	0,023	Certa	999.790.000	0	90
29/07/2019	0,000	0,024	Prevista	999.790.000	0	91
29/10/2019	0,000	0,024	Prevista	999.790.000	0	92
29/01/2020	0,000	0,024	Prevista	999.790.000	0	92
29/04/2020	0,000	0,024	Prevista	999.790.000	0	91
29/07/2020	0,000	0,024	Prevista	999.790.000	0	91
29/10/2020	0,000	0,024	Prevista	999.790.000	0	92
29/01/2021	0,000	0,024	Prevista	999.790.000	999.790.000	92

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
29/01/2018	29/01/2021	EURIBOR3M	1,000	0,400