

BANCO BPM 568a TF+TV 06/22 / IT0005187890
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
93,8 EUR	Banco BPM	22/06/2022	0,023%	2,029%	2,003%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	93,8
Rendimento lordo	2,02929
Rendimento netto	2,00309
Cedola in corso	0,02250
Rateo lordo	0,01325
Rateo netto	0,00981
Vita residua	3,35068
Duration modificata	0,03346
Convessità	0,03458
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	499.825.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	22/06/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	22/06/2016
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30E/360
Cedola massima %	0,81
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	22/06/2022
Data estinzione	22/06/2022
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	12/02/2019	93,6800 EUR
Euro TLX	13/02/2019	93,8000 EUR

Formula di indicizzazione

Primi 2 anni tasso fisso trimestrale dello 0.5625%. Poi:
 TV= (Euribor 3m(act/360) + 0.40)/4 (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
22/03/2019	0,000	0,023	Certa	499.825.000	0	90
22/06/2019	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	92
22/09/2019	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	92
22/12/2019	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	91
22/03/2020	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	91
22/06/2020	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	92
22/09/2020	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	92
22/12/2020	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	91
22/03/2021	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	90
22/06/2021	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	92
22/09/2021	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	92
22/12/2021	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	91
22/03/2022	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	0	90
22/06/2022	0,000	0,024	Prevista	499.825.000	499.825.000	92

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
22/06/2018	22/06/2022	EURIBOR3M	1,000	0,400