

B.IMI Euribor3m TF+TV 08/22 / XS1259647706

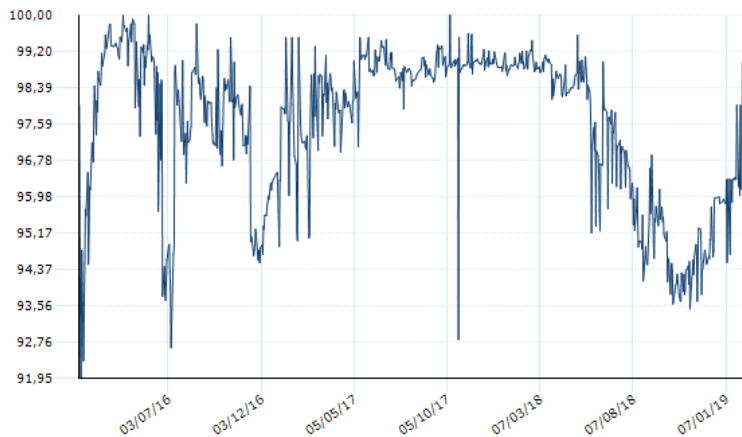
Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Grado Liquidità

Liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
97,77 EUR	Banca IMI	07/08/2022	0,181%	0,845%	0,794%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,77
Rendimento lordo	0,84492
Rendimento netto	0,79431
Cedola in corso	0,18100
Rateo lordo	0,09521
Rateo netto	0,07046
Vita residua	3,47671
Duration modificata	0,47540
Convessità	0,70141
Cedola successiva	0,19400
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	97,7700	EUR

Caratteristiche principali

Nominale circolante	10.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	07/08/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	07/08/2015
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola massima %	4,00
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	07/08/2022
Data estinzione	07/08/2022
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 annuo del 2.00%. Poi:
 TV= (Euribor 3m + 0.50) (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
07/08/2019	0,000	0,181	Certa	10.000.000	0	365
07/08/2020	0,000	0,194	Prevista	10.000.000	0	366
07/08/2021	0,000	0,194	Prevista	10.000.000	0	365
07/08/2022	0,000	0,194	Prevista	10.000.000	10.000.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
07/08/2017	07/08/2022	EURIBOR3M	1,000	0,500