

B.IMI Collezione EUR TF+TV 01/26 / XS1341083555

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
89,42 EUR	Banca IMI	26/01/2026	0,444%	2,095%	1,953%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	89,42
Rendimento lordo	2,09514
Rendimento netto	1,95296
Cedola in corso	0,44400
Rateo lordo	0,02433
Rateo netto	0,01800
Vita residua	6,95068
Duration modificata	0,79239
Convessità	1,42028
Cedola successiva	0,44400
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Banca IMI
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore Valuta
EuroMOT	13/02/2019	89,3200 EUR
Euro TLX	13/02/2019	89,4200 EUR

Caratteristiche principali

Nominale circolante	306.292.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	26/01/2016
Prezzo emissione	99,2200
Decorrenza prima cedola regolare	26/01/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	26/01/2026
Data estinzione	26/01/2026
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 annuo del 3.10%.
 Poi tasso variabile annuo così calcolato:
 $TV = (\text{Euribor } 3m + 0.75) \text{ (puntuale } 2gg)$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
26/01/2020	0,000	0,444	Certa	306.292.000	0	365
26/01/2021	0,000	0,444	Prevista	306.292.000	0	366
26/01/2022	0,000	0,444	Prevista	306.292.000	0	365
26/01/2023	0,000	0,444	Prevista	306.292.000	0	365
26/01/2024	0,000	0,444	Prevista	306.292.000	0	365
26/01/2025	0,000	0,444	Prevista	306.292.000	0	366
26/01/2026	0,000	0,444	Prevista	306.292.000	306.292.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
26/01/2018	26/01/2026	EURIBOR3M	1,000	0,750