

B.IMI Collezione EUR TF+TV 09/26 / XS1490787113

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
89,58 EUR	Banca IMI	28/09/2026	0,281%	1,766%	1,663%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	89,58
Rendimento lordo	1,76576
Rendimento netto	1,66342
Cedola in corso	0,28100
Rateo lordo	0,10778
Rateo netto	0,07976
Vita residua	7,62192
Duration modificata	0,39792
Convessità	0,55626
Cedola successiva	0,29400
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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	195.228.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	28/09/2016
Prezzo emissione	99,1500
Decorrenza prima cedola regolare	28/09/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola massima %	3,00
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	28/09/2026
Data estinzione	28/09/2026
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
EuroMOT	13/02/2019	89,0500 EUR
Euro TLX	13/02/2019	89,5800 EUR

Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso annuo del 3,00%.
Poi tasso variabile annuo così calcolato:
TV=(Euribor 3m + 0.60) (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
28/09/2019	0,000	0,281	Certa	195.228.000	0	365
28/09/2020	0,000	0,294	Prevista	195.228.000	0	366
28/09/2021	0,000	0,294	Prevista	195.228.000	0	365
28/09/2022	0,000	0,294	Prevista	195.228.000	0	365
28/09/2023	0,000	0,294	Prevista	195.228.000	0	365
28/09/2024	0,000	0,294	Prevista	195.228.000	0	366
28/09/2025	0,000	0,294	Prevista	195.228.000	0	365
28/09/2026	0,000	0,294	Prevista	195.228.000	195.228.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
28/09/2018	28/09/2026	EURIBOR3M	1,000	0,600