

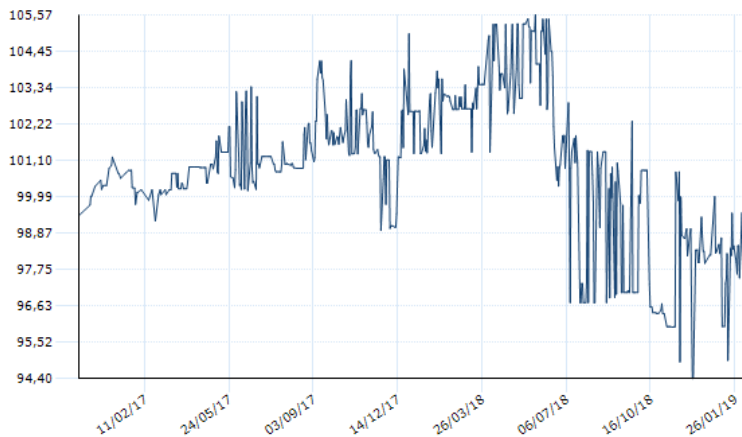
B.IMI Collezione GBP TF+TV 11/22 / XS1522284576
Grado di rischio calcolato

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
95,35 GBP	Banca IMI	23/11/2022	3,000%	3,488%	2,898%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	95,35
Rendimento lordo	3,48766
Rendimento netto	2,89788
Cedola in corso	3,00000
Rateo lordo	0,69041
Rateo netto	0,51090
Vita residua	3,77260
Duration modificata	0,76490
Convessità	1,34997
Cedola successiva	1,92410
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Banca IMI
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	GBP
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	24.696.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	23/11/2016
Prezzo emissione	99,7000
Decorrenza prima cedola regolare	23/11/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola massima %	3,00
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	23/11/2022
Data estinzione	23/11/2022
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
EuroMOT	13/02/2019	98,4300 GBP
Euro TLX	13/02/2019	95,3500 GBP

Formula di indicizzazione

Primi tre anni tasso fisso annuo del 3,00%.
Poi tasso variabile annuo così calcolato:
TV=(GBPLibor 3m + 1,00) (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
23/11/2019	3,000	3,000	Certa	24.696.000	0	365
23/11/2020	0,000	1,924	Prevista	24.696.000	0	366
23/11/2021	0,000	1,924	Prevista	24.696.000	0	365
23/11/2022	0,000	1,924	Prevista	24.696.000	24.696.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
23/11/2019	23/11/2022	GBPLIBOR3M	1,000	1,000