

## B.IMI Collezione EUR TF+TV 05/27 / XS1608207566

## 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
92,43 EUR	Banca IMI	17/05/2027	3,400%	1,267%	1,173%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	92,43
Rendimento lordo	1,26675
Rendimento netto	1,17275
Cedola in corso	3,40000
Rateo lordo	2,55233
Rateo netto	1,88872
Vita residua	8,25479
Duration modificata	0,09704
Convessità	0,10646
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
EuroMOT	13/02/2019	91,9200 EUR
Euro TLX	13/02/2019	92,4300 EUR

## Caratteristiche principali

Nominale circolante	300.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	17/05/2017
Prezzo emissione	99,4700
Decorrenza prima cedola regolare	17/05/2017
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola massima %	3,40
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	17/05/2027
Data estinzione	17/05/2027
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 3,40%.  
Poi tasso variabile annuo così calcolato:  
TV=(Euribor 3m + 0.50) (puntuale 2gg)

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
17/05/2019	3,400	3,400	Certa	300.000.000	0	365
17/05/2020	0,000	0,194	Prevista	300.000.000	0	366
17/05/2021	0,000	0,194	Prevista	300.000.000	0	365
17/05/2022	0,000	0,194	Prevista	300.000.000	0	365
17/05/2023	0,000	0,194	Prevista	300.000.000	0	365
17/05/2024	0,000	0,194	Prevista	300.000.000	0	366
17/05/2025	0,000	0,194	Prevista	300.000.000	0	365
17/05/2026	0,000	0,194	Prevista	300.000.000	0	365
17/05/2027	0,000	0,194	Prevista	300.000.000	300.000.000	365

## Annotazioni

Collezione SERIE V.  
IMI Serie 15.

## Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
17/05/2019	17/05/2027	EURIBOR3M	1,000	0,500