

B.IMI Collezione USD TF+TV 10/20 / IT0004966229

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
99,12 USD	Banca IMI	18/10/2020	3,445%	4,152%	3,210%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,116
Rendimento lordo	4,15159
Rendimento netto	3,21047
Cedola in corso	3,44460
Rateo lordo	1,13246
Rateo netto	0,83802
Vita residua	1,67397
Duration modificata	0,69081
Convessità	1,16802
Cedola successiva	3,73600
Mercato di riferimento	EuroMOT

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	229.030.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	18/10/2013
Prezzo emissione	99,9400
Decorrenza prima cedola regolare	18/10/2013
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	18/10/2020
Data estinzione	18/10/2020
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	99,1160	USD
Euro TLX	13/02/2019	99,0800	USD

Formula di indicizzazione

Prim due anni tasso fisso del 4.00%.
Poi cedole variabili annuali così calcolate:
TV= (USDLibor 3m + 1.00) (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/10/2019	3,445	3,445	Certa	229.030.000	0	365
18/10/2020	0,000	3,736	Prevista	229.030.000	229.030.000	366

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
18/10/2015	18/10/2020	USDLIBOR3M	1,000	1,000