

B.IMI Collezione USD TF+TV 03/19 / IT0005001422

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
99,9 USD	Banca IMI	13/03/2019	2,299%	3,634%	3,066%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,896
Rendimento lordo	3,63351
Rendimento netto	3,06598
Cedola in corso	2,29880
Rateo lordo	2,13500
Rateo netto	1,57990
Vita residua	0,07123
Duration modificata	0,06874
Convessità	0,07106
Cedola successiva	0,00000
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	207.898.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regolar
Data emissione	13/03/2014
Prezzo emissione	99,8500
Decorrenza prima cedola regolare	13/03/2014
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	13/03/2019
Data estinzione	13/03/2019
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	99,8960	USD
Euro TLX	13/02/2019	99,8200	USD

Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso del 3,00%.
 Poi cedole variabili annuali cos' calcolate:
 $TV = (\text{USDLibor } 3m + 0,21)$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
13/03/2019	2,299	2,299	Certa	207.898.000	207.898.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
13/03/2016	13/03/2019	USDLIBOR3M	1,000	0,210