

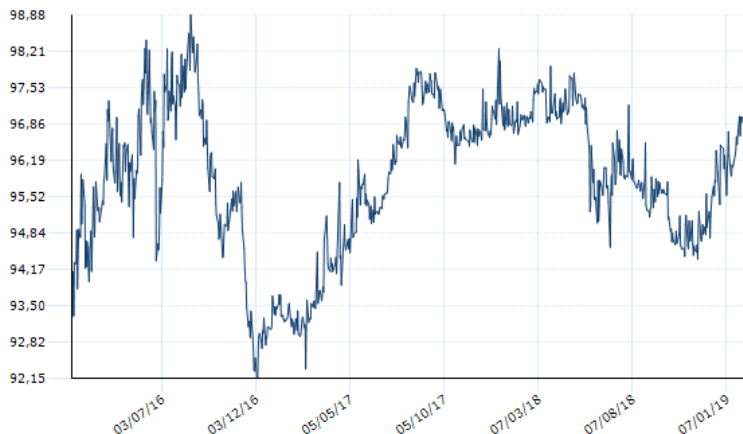
Grado di rischio calcolato

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
96,95 USD	Banca IMI	07/04/2021	2,331%	4,221%	3,502%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	96,95
Rendimento lordo	4,22053
Rendimento netto	3,50232
Cedola in corso	2,33060
Rateo lordo	2,00498
Rateo netto	1,48369
Vita residua	2,14247
Duration modificata	0,11804
Convessità	0,13198
Cedola successiva	2,73600
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Euro TLX	13/02/2019	96,9500	USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	119.198.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	07/04/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	07/04/2015
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola minima %	1,00
Cedola massima %	3,90
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	07/04/2021
Data estinzione	07/04/2021
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 del 3.00%.

Poi cedole variabili annuali così' calcolate:

 $TV = (\text{USDLibor } 3m) \text{ (puntuale } 2gg)$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
07/04/2019	0,000	2,331	Certa	119.198.000	0	365
07/04/2020	0,000	2,736	Prevista	119.198.000	0	366
07/04/2021	0,000	2,736	Prevista	119.198.000	119.198.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione	Peso	Spread
07/04/2017	07/04/2021	USDLIBOR3M	1,000	0,000