

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
94 GBP	Banca IMI	14/05/2022	1,172%	3,380%	2,989%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	94
Rendimento lordo	3,38036
Rendimento netto	2,98925
Cedola in corso	1,17170
Rateo lordo	0,88923
Rateo netto	0,65803
Vita residua	3,24384
Duration modificata	0,17364
Convessità	0,20380
Cedola successiva	1,42400
Mercato di riferimento	EuroMOT

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	30.637.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	14/05/2015
Prezzo emissione	99,6300
Decorrenza prima cedola regolare	14/05/2015
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	14/05/2022
Data estinzione	14/05/2022
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	94,0000 GBP
Euro TLX	13/02/2019	96,9300 GBP

Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso annuo del 3.30%.
 Poi cedole variabili annuali così calcolate:
 $TV = (GBPLibor\ 3m + 0.50)$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
14/05/2019	0,000	1,172	Certa	30.637.000	0	365
14/05/2020	0,000	1,424	Prevista	30.637.000	0	366
14/05/2021	0,000	1,424	Prevista	30.637.000	0	365
14/05/2022	0,000	1,424	Prevista	30.637.000	30.637.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
14/05/2017	14/05/2022	GBPLIBOR3M	1,000	0,500