

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
94,49 USD	Banca IMI	14/05/2022	2,855%	5,075%	4,203%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	94,49
Rendimento lordo	5,07491
Rendimento netto	4,20314
Cedola in corso	2,85500
Rateo lordo	2,16667
Rateo netto	1,60334
Vita residua	3,24384
Duration modificata	0,19594
Convessità	0,23434
Cedola successiva	3,23600
Mercato di riferimento	Mercato Tel. Obbligazioni

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	95.748.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	14/05/2015
Prezzo emissione	99,6600
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
Mercato Tel. Obbligazioni	13/02/2019	94,4900	USD
Euro TLX	13/02/2019	91,8900	USD

Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso del 3,60%.
 Poi cedole variabili annuali cos' calcolate:
 $TV = (\text{USDLibor } 3m + 0.50) \text{ (puntuale 2gg)}$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
14/05/2019	0,000	2,855	Certa	95.748.000	0	365
14/05/2020	0,000	3,236	Prevista	95.748.000	0	366
14/05/2021	0,000	3,236	Prevista	95.748.000	0	365
14/05/2022	0,000	3,236	Prevista	95.748.000	95.748.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
14/05/2017	14/05/2022	USDLIBOR3M	1,000	0,500