

B.IMI USD 3.50% 06/22 / XS1251080088

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 USD	Banca IMI	26/06/2022	3,500%	3,811%	2,893%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99
Rendimento lordo	3,81147
Rendimento netto	2,89275
Cedola in corso	3,50000
Rateo lordo	2,24384
Rateo netto	1,66044
Vita residua	3,36164
Duration modificata	3,04833
Convessità	12,62905
Cedola successiva	3,50000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
EuroMOT	13/02/2019	99,5900	USD
Euro TLX	13/02/2019	99,0000	USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	142.652.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	26/06/2015
Prezzo emissione	99,8000
Decorrenza prima cedola regolare	26/06/2015
Tasso annuale	3,5000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	26/06/2022
Data estinzione	26/06/2022
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
26/06/2019	3,500	3,500	Certa	142.652.000	0	365
26/06/2020	3,500	3,500	Certa	142.652.000	0	366
26/06/2021	3,500	3,500	Certa	142.652.000	0	365
26/06/2022	3,500	3,500	Certa	142.652.000	142.652.000	365