

## B.IMI Collezione USD TF+TV 01/23 / XS1341083639

## 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 USD	Banca IMI	26/01/2023	3,765%	5,470%	4,407%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	94
Rendimento lordo	5,47004
Rendimento netto	4,40674
Cedola in corso	3,76480
Rateo lordo	0,20629
Rateo netto	0,15265
Vita residua	3,94795
Duration modificata	0,91841
Convessità	1,76190
Cedola successiva	3,73620
Mercato di riferimento	Euro TLX

## Dati anagrafici principali

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

## Caratteristiche principali

Nominale circolante	158.492.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	26/01/2016
Prezzo emissione	98,3400
Decorrenza prima cedola regolare	26/01/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	26/01/2023
Data estinzione	26/01/2023
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	94,3700 USD
Euro TLX	13/02/2019	94,0000 USD

## Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso annuo del 4.50%.  
 Poi tasso variabile annuo così calcolato:  
 $TV = (\text{USDLibor } 3m + 1.00) \text{ (puntuale 2gg)}$

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
26/01/2020	3,765	3,765	Certa	158.492.000	0	365
26/01/2021	0,000	3,736	Prevista	158.492.000	0	366
26/01/2022	0,000	3,736	Prevista	158.492.000	0	365
26/01/2023	0,000	3,736	Prevista	158.492.000	158.492.000	365

## Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
26/01/2014	26/01/2023	USDLIBOR3M	1,000	1,000