

B.IMI 13a USD TF+TV 05/24 / XS1378969072

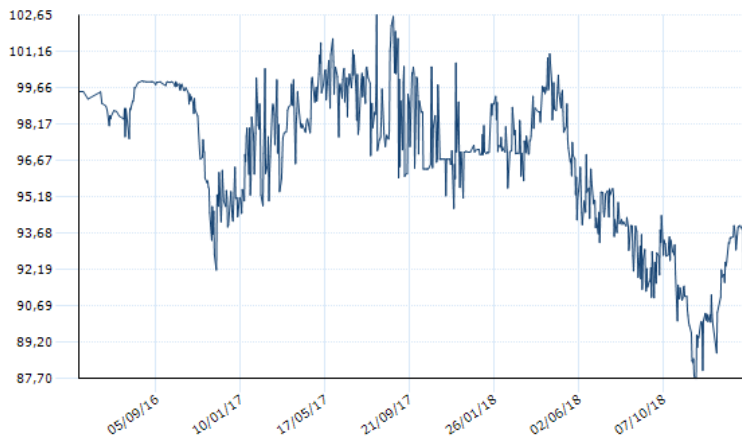
## Grado di rischio calcolato

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
91,2 USD	Banca IMI	10/05/2024	4,000%	5,244%	4,325%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	91,2
Rendimento lordo	5,24443
Rendimento netto	4,32529
Cedola in corso	4,00000
Rateo lordo	3,07945
Rateo netto	2,27879
Vita residua	5,23562
Duration modificata	1,06171
Convessità	2,18894
Cedola successiva	4,00000
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
EuroMOT	13/02/2019	90,8400 USD
Euro TLX	13/02/2019	91,2000 USD

## Caratteristiche principali

Nominale circolante	110.800.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	10/05/2016
Prezzo emissione	99,5000
Decorrenza prima cedola regolare	10/05/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola massima %	4,00
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	10/05/2024
Data estinzione	10/05/2024
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 4 anni tasso fisso annuo del 4.00%.  
Poi tasso variabile annuale così calcolato:  
TV=(USDLibor 3m + 0.30) (puntuale 2gg)

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
10/05/2019	4,000	4,000	Certa	110.800.000	0	365
10/05/2020	4,000	4,000	Certa	110.800.000	0	366
10/05/2021	0,000	3,036	Prevista	110.800.000	0	365
10/05/2022	0,000	3,036	Prevista	110.800.000	0	365
10/05/2023	0,000	3,036	Prevista	110.800.000	0	365
10/05/2024	0,000	3,036	Prevista	110.800.000	110.800.000	366

## Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
10/05/2020	10/05/2024	USDLIBOR3M	1,000	0,300