

B.IMI Collezione USD TF+TV 01/23 / XS1555142568

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
95,85 USD	Banca IMI	25/01/2023	3,750%	4,929%	3,911%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	95,85
Rendimento lordo	4,92874
Rendimento netto	3,91075
Cedola in corso	3,75000
Rateo lordo	0,21575
Rateo netto	0,15966
Vita residua	3,94521
Duration modificata	0,98619
Convessità	1,95875
Cedola successiva	3,75000
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	95,9000 USD
Euro TLX	13/02/2019	95,8500 USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	85.680.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	25/01/2017
Prezzo emissione	99,5500
Decorrenza prima cedola regolare	25/01/2017
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola massima %	3,75
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	25/01/2023
Data estinzione	25/01/2023
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Formula di indicizzazione

Primi tre anni tasso fisso annuo del 3,75%.
Poi tasso variabile annuo così calcolato:
TV=(USDLibor 3m + 1.50) (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
25/01/2020	3,750	3,750	Certa	85.680.000	0	365
25/01/2021	0,000	3,750	Prevista	85.680.000	0	366
25/01/2022	0,000	3,750	Prevista	85.680.000	0	365
25/01/2023	0,000	3,750	Prevista	85.680.000	85.680.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione	Peso	Spread
25/01/2020	25/01/2023	USDLIBOR3M	1,000	1,500