

B.IMI 14a USDLibor3m TF+TV 07/24 / XS1588019650

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
91,67 USD	Banca IMI	07/06/2024	4,000%	5,334%	4,376%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	91,67
Rendimento lordo	5,33445
Rendimento netto	4,37595
Cedola in corso	4,00000
Rateo lordo	2,77260
Rateo netto	2,05173
Vita residua	5,31233
Duration modificata	0,20243
Convessità	0,24341
Cedola successiva	3,46620
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

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Euro TLX	13/02/2019	91,6700	USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	100.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	07/06/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	07/06/2017
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	07/06/2024
Data estinzione	07/06/2024
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 due anni tasso fisso annuo del 4.00%.
 Poi tasso variabile annuale così calcolato:
 $TV = (\text{USDLibor } 3m + 0.73)$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
07/06/2019	4,000	4,000	Certa	100.000.000	0	365
07/06/2020	0,000	3,466	Prevista	100.000.000	0	366
07/06/2021	0,000	3,466	Prevista	100.000.000	0	365
07/06/2022	0,000	3,466	Prevista	100.000.000	0	365
07/06/2023	0,000	3,466	Prevista	100.000.000	0	365
07/06/2024	0,000	3,466	Prevista	100.000.000	100.000.000	366

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
07/06/2019	07/06/2024	USDLIBOR3M	1,000	0,730