

## B.IMI Collezione USD TF+TV 05/25 / XS1608207640

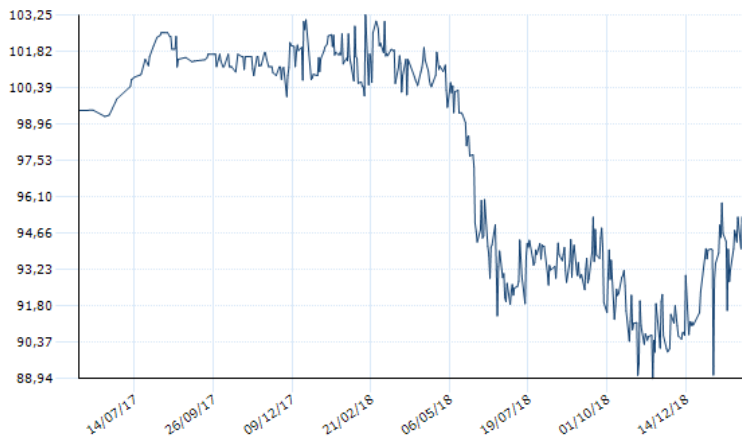
## Grado di rischio calcolato

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
93,9 USD	Banca IMI	17/05/2025	4,000%	4,989%	3,940%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	93,9
Rendimento lordo	4,98880
Rendimento netto	3,94027
Cedola in corso	4,00000
Rateo lordo	3,00274
Rateo netto	2,22203
Vita residua	6,25479
Duration modificata	2,18634
Convessità	6,96641
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

## Caratteristiche principali

Nominale circolante	300.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	17/05/2017
Prezzo emissione	99,5600
Decorrenza prima cedola regolare	17/05/2017
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola massima %	4,00
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	17/05/2025
Data estinzione	17/05/2025
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	92,0100 USD
Euro TLX	13/02/2019	93,9000 USD

## Formula di indicizzazione

Primi quattro anni tasso fisso annuo del 4.00%.  
Poi tasso variabile annuo così calcolato:  
TV=(USDLibor 3m + 1.00) (puntuale 2gg)

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
17/05/2019	4,000	4,000	Certa	300.000.000	0	365
17/05/2020	4,000	4,000	Certa	300.000.000	0	366
17/05/2021	4,000	4,000	Certa	300.000.000	0	365
17/05/2022	0,000	3,736	Prevista	300.000.000	0	365
17/05/2023	0,000	3,736	Prevista	300.000.000	0	365
17/05/2024	0,000	3,736	Prevista	300.000.000	0	366
17/05/2025	0,000	3,736	Prevista	300.000.000	300.000.000	365

## Annotazioni

Collezione Serie VII.  
IMI Serie 16.

## Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
17/05/2021	17/05/2025	USDLIBOR3M	1,000	1,000