

## B.IMI Collezione USD TF+TV 11/25 / XS1720195285

## 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
90,77 USD	Banca IMI	24/11/2025	4,000%	4,933%	4,017%



## Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	90,77
Rendimento lordo	4,93291
Rendimento netto	4,01660
Cedola in corso	4,00000
Rateo lordo	0,90959
Rateo netto	0,67310
Vita residua	6,77808
Duration modificata	2,45542
Convessità	8,48449
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	24/11/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	24/11/2017
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola minima %	1,40
Cedola massima %	4,00
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	24/11/2025
Data estinzione	24/11/2025
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	91,0700 USD
Euro TLX	13/02/2019	90,7700 USD

## Formula di indicizzazione

Primi quattro anni tasso fisso annuo del 4.00%.  
Poi tasso variabile annuo così calcolato:  
 $TV = (\text{USDLibor } 3m) \text{ (puntuale } 2gg)$

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
24/11/2019	4,000	4,000	Certa	300.000.000	0	365
24/11/2020	4,000	4,000	Certa	300.000.000	0	366
24/11/2021	4,000	4,000	Certa	300.000.000	0	365
24/11/2022	0,000	2,736	Prevista	300.000.000	0	365
24/11/2023	0,000	2,736	Prevista	300.000.000	0	365
24/11/2024	0,000	2,736	Prevista	300.000.000	0	366
24/11/2025	0,000	2,736	Prevista	300.000.000	300.000.000	365

## Annotazioni

Collezione Tasso Misto Euro Serie VIII

## Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
24/11/2021	24/11/2025	USDLIBOR3M	1,000	0,000