

APPLE INC 3.20% 05/27 / US037833CR93
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
99,21 USD	Apple	11/05/2027	1,600%	3,337%	2,490%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,21
Rendimento lordo	3,33741
Rendimento netto	2,48976
Cedola in corso	1,60000
Rateo lordo	0,83556
Rateo netto	0,61831
Vita residua	8,23836
Duration modificata	7,00870
Convessità	60,21805
Cedola successiva	1,60000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Apple
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	11/05/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	11/05/2017
Tasso annuale	3,2000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	11/05/2027
Data estinzione	11/05/2027
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	12/02/2019	98,8400	USD
Börse Düsseldorf	12/02/2019	98,8600	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	98,9700	USD
Börse Berlin	12/02/2019	98,9700	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	98,9400	USD
Euro TLX	13/02/2019	99,2100	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
11/05/2019	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	181
11/11/2019	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	184
11/05/2020	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	182
11/11/2020	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	184
11/05/2021	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	181
11/11/2021	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	184
11/05/2022	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	181
11/11/2022	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	184
11/05/2023	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	181
11/11/2023	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	184
11/05/2024	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	182
11/11/2024	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	184
11/05/2025	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	181
11/11/2025	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	184
11/05/2026	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	181
11/11/2026	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	0	184
11/05/2027	3,200	1,600	Certa	2.000.000.000	2.000.000.000	181

Annotazioni

Callabile fino al 10/02/2027 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 30 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	11/05/2017	10/02/2027	100	30
Call dal	11/02/2027	10/05/2027	100	30