

CELGENE CORP 3.25% 08/22 / US151020AH73
Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Grado Liquidità

Poco liquido

12/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
99,27 USD	Celgene	15/08/2022	1,625%	3,504%	2,642%


Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	99,27
Rendimento lordo	3,50444
Rendimento netto	2,64157
Cedola in corso	1,62500
Rateo lordo	1,61597
Rateo netto	1,19582
Vita residua	3,50137
Duration modificata	3,17258
Convessità	13,59904
Cedola successiva	1,62500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	09/08/2012
Prezzo emissione	99,9490
Decorrenza prima cedola regolare	15/02/2013
Data Prorata	09/08/2012
Tasso annuale	3,2500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/08/2022
Data estinzione	15/08/2022
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	99,2700 USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	99,6100 USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/02/2019	3,250	1,625	Certa	1.000.000.000	0	184
15/08/2019	3,250	1,625	Certa	1.000.000.000	0	181
15/02/2020	3,250	1,625	Certa	1.000.000.000	0	184
15/08/2020	3,250	1,625	Certa	1.000.000.000	0	182
15/02/2021	3,250	1,625	Certa	1.000.000.000	0	184
15/08/2021	3,250	1,625	Certa	1.000.000.000	0	181
15/02/2022	3,250	1,625	Certa	1.000.000.000	0	184
15/08/2022	3,250	1,625	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	181

Annotazioni

Callable fino al 14/08/2022 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 25 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	09/08/2012	14/08/2022	100	30