

CELGENE CORP 5.25% 08/43 / US151020AL85
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
102,1 USD	Celgene	15/08/2043	2,625%	5,161%	3,783%


Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	102,096
Rendimento lordo	5,16055
Rendimento netto	3,78290
Cedola in corso	2,62500
Rateo lordo	2,61042
Rateo netto	1,93171
Vita residua	24,51507
Duration modificata	13,14625
Convessità	256,66926
Cedola successiva	2,62500
Mercato di riferimento	Börse Berlin

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	400.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	06/08/2013
Prezzo emissione	99,1470
Decorrenza prima cedola regolare	15/02/2014
Data Prorata	06/08/2013
Tasso annuale	5,2500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/08/2043
Data estinzione	15/08/2043
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	101,7500	USD
Börse Berlin	12/02/2019	102,0960	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/02/2019	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	184
15/08/2019	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	181
15/02/2020	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	184
15/08/2020	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	182
15/02/2021	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	184
15/08/2021	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	181
15/02/2022	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	184
15/08/2022	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	181
15/02/2023	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	184
15/08/2023	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	181
15/02/2024	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	184
15/08/2024	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	182
15/02/2025	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	184
15/08/2025	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	181
15/02/2026	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	184
15/08/2026	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	181
15/02/2027	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	184
15/08/2027	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	181
15/02/2028	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	0	184
.....						
15/08/2043	5,250	2,625	Prevista	400.000.000	400.000.000	181

Annotazioni

Callable fino al 14/02/2043 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 25 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	06/08/2013	14/08/2043	100	30