

EMC CORP 2.65% 06/20 / US268648AQ50
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Poco liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
98,5 USD	EMC	01/06/2020	1,325%	3,887%	3,172%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,5
Rendimento lordo	3,88740
Rendimento netto	3,17182
Cedola in corso	1,32500
Rateo lordo	0,54472
Rateo netto	0,40309
Vita residua	1,29315
Duration modificata	1,22583
Convessità	2,69746
Cedola successiva	1,32500
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	EMC
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	Pro-rata
Data emissione	06/06/2013
Prezzo emissione	99,7600
Decorrenza prima cedola regolare	01/12/2013
Data Prorata	06/06/2013
Tasso annuale	2,6500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/06/2020
Data estinzione	01/06/2020
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	98,0430	USD
Börse Düsseldorf	12/02/2019	98,1400	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	98,2400	USD
Börse Berlin	12/02/2019	98,2420	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	98,2400	USD
Euro TLX	13/02/2019	98,5000	USD
Hi-MTF	13/02/2019	98,4100	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/06/2019	2,650	1,325	Certa	2.000.000.000	0	182
01/12/2019	2,650	1,325	Certa	2.000.000.000	0	183
01/06/2020	2,650	1,325	Certa	2.000.000.000	2.000.000.000	183

Annotazioni

Callable fino al 31/05/2020 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 20 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	06/06/2013	31/05/2020	100	30