

JP MORGAN CHASE&Co. 2.972% 01/23 / US48128BAB71

Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
99,31 USD	JPMorgan Chase & Co	15/01/2023	1,486%	3,182%	2,396%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,31
Rendimento lordo	3,18227
Rendimento netto	2,39645
Cedola in corso	1,48600
Rateo lordo	0,24767
Rateo netto	0,18327
Vita residua	3,91781
Duration modificata	3,60533
Convessità	16,93103
Cedola successiva	1,48600
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	JPMorgan Chase & Co
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	08/12/2016
Prezzo emissione	99,9970
Decorrenza prima cedola regolare	15/07/2017
Data Prorata	08/12/2016
Tasso annuale	2,9720
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/01/2023
Data estinzione	15/01/2023
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	99,0000	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	99,0100	USD
Börse Berlin	12/02/2019	98,8700	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	99,0300	USD
Euro TLX	13/02/2019	99,3100	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/07/2019	2,972	1,486	Certa	1.500.000.000	0	181
15/01/2020	2,972	1,486	Certa	1.500.000.000	0	184
15/07/2020	2,972	1,486	Certa	1.500.000.000	0	182
15/01/2021	2,972	1,486	Certa	1.500.000.000	0	184
15/07/2021	2,972	1,486	Certa	1.500.000.000	0	181
15/01/2022	2,972	1,486	Certa	1.500.000.000	0	184
15/07/2022	2,972	1,486	Certa	1.500.000.000	0	181
15/01/2023	2,972	1,486	Certa	1.500.000.000	1.500.000.000	184

Annotazioni

Callable fino al 14/12/2022 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 20 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	15/07/2017	14/12/2022	100	30
---	15/01/2022	15/01/2022	100	30
Call dal	15/12/2022	14/01/2023	100	30