

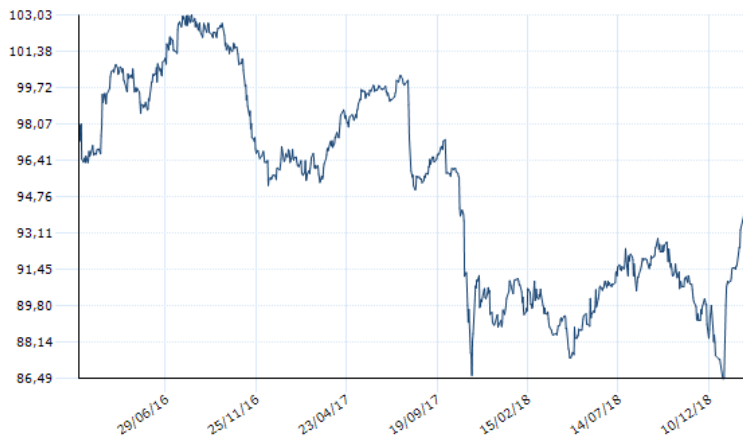
TEVA PHARMACEUTICAL 2.95% 12/22 / US88165FAG72
Grado di rischio calcolato

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
92,91 USD	Teva Pharmaceutical Finance Ne..	18/12/2022	1,475%	5,060%	4,238%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	92,91
Rendimento lordo	5,06008
Rendimento netto	4,23814
Cedola in corso	1,47500
Rateo lordo	0,46708
Rateo netto	0,34564
Vita residua	3,84110
Duration modificata	3,46122
Convessità	15,71332
Cedola successiva	1,47500
Mercato di riferimento	Börse Düsseldorf

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Teva Pharmaceutical Finance Netherland
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	841.821.680
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	18/12/2012
Prezzo emissione	99,8020
Decorrenza prima cedola regolare	18/12/2012
Tasso annuale	2,9500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	18/12/2022
Data estinzione	18/12/2022
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	13/02/2019	93,0300	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	92,9100	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	92,9200	USD
Börse Berlin	13/02/2019	93,8000	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	92,9200	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/06/2019	2,950	1,475	Certa	841.821.680	0	182
18/12/2019	2,950	1,475	Certa	841.821.680	0	183
18/06/2020	2,950	1,475	Certa	841.821.680	0	183
18/12/2020	2,950	1,475	Certa	841.821.680	0	183
18/06/2021	2,950	1,475	Certa	841.821.680	0	182
18/12/2021	2,950	1,475	Certa	841.821.680	0	183
18/06/2022	2,950	1,475	Certa	841.821.680	0	182
18/12/2022	2,950	1,475	Certa	841.821.680	841.821.680	183

Annotazioni

Callable fino al 17/12/2022 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 20 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	18/12/2012	17/12/2022	100	30