

TEVA PHARMACEUTICAL 3.65% 11/21 / US88166JAA16
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
97,26 USD	Teva Pharmaceutical Finance Ne..	10/11/2021	1,825%	4,783%	3,791%


Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	97,256
Rendimento lordo	4,78253
Rendimento netto	3,79125
Cedola in corso	1,82500
Rateo lordo	0,95306
Rateo netto	0,70526
Vita residua	2,73973
Duration modificata	2,48690
Convessità	8,76785
Cedola successiva	1,82500
Mercato di riferimento	Börse Berlin

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Teva Pharmaceutical Finance Netherland
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	587.610.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	10/11/2011
Prezzo emissione	99,6350
Decorrenza prima cedola regolare	10/11/2011
Tasso annuale	3,6500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	10/11/2021
Data estinzione	10/11/2021
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	12/02/2019	97,3200	USD
Börse Düsseldorf	12/02/2019	97,4700	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	97,4900	USD
Börse Berlin	12/02/2019	97,2560	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	97,4300	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
10/05/2019	3,650	1,825	Certa	587.610.000	0	181
10/11/2019	3,650	1,825	Certa	587.610.000	0	184
10/05/2020	3,650	1,825	Certa	587.610.000	0	182
10/11/2020	3,650	1,825	Certa	587.610.000	0	184
10/05/2021	3,650	1,825	Certa	587.610.000	0	181
10/11/2021	3,650	1,825	Certa	587.610.000	587.610.000	184