

JC PENNEY CO INC 5.875% 07/23 / USU7083NAB74
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Altamente illiquido

02/01/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
79 USD	J.C. Penney Corporation	01/07/2023	2,938%	12,419%	10,560%


Analisi

Data ultima quotazione	02/01/2019
Data valutazione	02/01/2019
Data valuta	04/01/2019
Prezzo	79
Rendimento lordo	12,41872
Rendimento netto	10,56008
Cedola in corso	2,93750
Rateo lordo	0,04896
Rateo netto	0,03623
Vita residua	4,49041
Duration modificata	3,50570
Convessità	16,45849
Cedola successiva	2,93750
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	J.C. Penney Corporation
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	23/06/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	01/01/2017
Data Prorata	23/06/2016
Tasso annuale	5,8750
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/07/2023
Data estinzione	01/07/2023
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/07/2019	5,875	2,938	Prevista	500.000.000	0	181
01/01/2020	5,875	2,938	Prevista	500.000.000	0	184
01/07/2020	5,875	2,938	Prevista	500.000.000	0	182
01/01/2021	5,875	2,938	Prevista	500.000.000	0	184
01/07/2021	5,875	2,938	Prevista	500.000.000	0	181
01/01/2022	5,875	2,938	Prevista	500.000.000	0	184
01/07/2022	5,875	2,938	Prevista	500.000.000	0	181
01/01/2023	5,875	2,938	Prevista	500.000.000	0	184
01/07/2023	5,875	2,938	Prevista	500.000.000	500.000.000	181

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	01/07/2019	30/06/2020	102,938	30