

CNH INDUSTRIAL LLC 4.875% 04/21 / US12592BAF13
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
102,21 USD	CNH Industrial Capital	01/04/2021	2,438%	3,821%	2,526%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	102,21
Rendimento lordo	3,82135
Rendimento netto	2,52552
Cedola in corso	2,43750
Rateo lordo	1,81458
Rateo netto	1,34279
Vita residua	2,12603
Duration modificata	1,93746
Convessità	5,76830
Cedola successiva	2,43750
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	CNH Industrial Capital
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	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	17/03/2016
Prezzo emissione	99,4470
Decorrenza prima cedola regolare	01/10/2016
Data Prorata	17/03/2016
Tasso annuale	4,8750
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/04/2021
Data estinzione	01/04/2021
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	101,9300	USD
Börse Berlin	13/02/2019	101,5300	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	102,1800	USD
Euro TLX	13/02/2019	102,2100	USD
Hi-MTF	13/02/2019	102,1000	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/04/2019	4,875	2,438	Certa	500.000.000	0	182
01/10/2019	4,875	2,438	Certa	500.000.000	0	183
01/04/2020	4,875	2,438	Certa	500.000.000	0	183
01/10/2020	4,875	2,438	Certa	500.000.000	0	183
01/04/2021	4,875	2,438	Certa	500.000.000	500.000.000	182

Annotazioni

Callable fino al 31/03/2021 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 50 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	17/03/2016	31/03/2021	100	30