

FCA NV 4.50% 04/20 / US31562QAC15

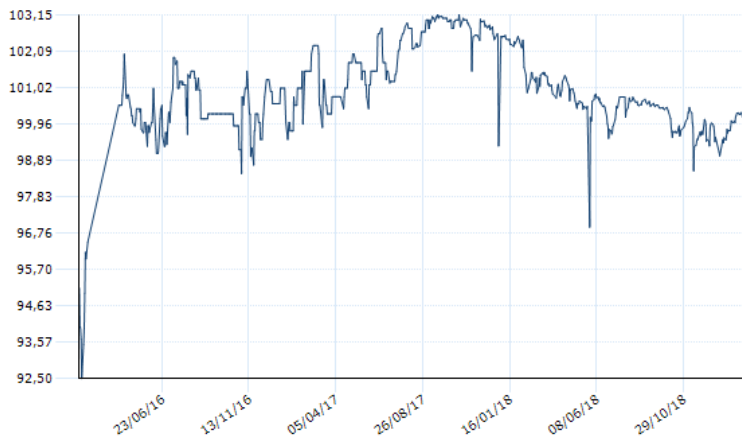
Grado di rischio calcolato

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
100,06 USD	FCA Fiat Chrysler Automobiles	15/04/2020	2,250%	4,501%	3,308%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,06
Rendimento lordo	4,50072
Rendimento netto	3,30824
Cedola in corso	2,25000
Rateo lordo	1,50000
Rateo netto	1,11000
Vita residua	1,16438
Duration modificata	1,08280
Convessità	2,23285
Cedola successiva	2,25000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	FCA Fiat Chrysler Automobiles
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.460.345.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	200.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	14/04/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	15/10/2015
Data Prorata	14/04/2015
Tasso annuale	4,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/04/2020
Data estinzione	15/04/2020
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	100,0600	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	99,5600	USD
ExtraMOT	13/02/2019	100,4040	USD
Euro TLX	13/02/2019	100,6300	USD
Hi-MTF	13/02/2019	100,5100	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/04/2019	4,500	2,250	Certa	1.460.345.000	0	182
15/10/2019	4,500	2,250	Certa	1.460.345.000	0	183
15/04/2020	4,500	2,250	Certa	1.460.345.000	1.460.345.000	183

Annotazioni

Callable fino al 14/04/2020 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 50 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	14/04/2015	14/04/2020	100	30