

HSBC HOLDINGS PLC 3.60% 05/23 / US404280BA69
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Liquido

12/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
99,86 USD	HSBC Holdings	25/05/2023	1,800%	3,671%	2,718%


Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	99,86
Rendimento lordo	3,67098
Rendimento netto	2,71776
Cedola in corso	1,80000
Rateo lordo	0,79000
Rateo netto	0,58460
Vita residua	4,27671
Duration modificata	3,83061
Convessità	19,09652
Cedola successiva	1,80000
Mercato di riferimento	Börse Berlin

Dati anagrafici principali

Ente emittente	HSBC Holdings
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	200.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	25/05/2016
Prezzo emissione	99,9630
Decorrenza prima cedola regolare	25/05/2016
Tasso annuale	3,6000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	25/05/2023
Data estinzione	25/05/2023
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	100,3350	USD
Börse Berlin	12/02/2019	99,8600	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	100,3100	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
25/05/2019	3,600	1,800	Certa	2.000.000.000	0	181
25/11/2019	3,600	1,800	Certa	2.000.000.000	0	184
25/05/2020	3,600	1,800	Certa	2.000.000.000	0	182
25/11/2020	3,600	1,800	Certa	2.000.000.000	0	184
25/05/2021	3,600	1,800	Certa	2.000.000.000	0	181
25/11/2021	3,600	1,800	Certa	2.000.000.000	0	184
25/05/2022	3,600	1,800	Certa	2.000.000.000	0	181
25/11/2022	3,600	1,800	Certa	2.000.000.000	0	184
25/05/2023	3,600	1,800	Certa	2.000.000.000	2.000.000.000	181