

CNH INDUSTRIAL FIN. 2.75% 03/19 / XS1046851025
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
100,38 EUR	CNH Industrial Finance Europe	18/03/2019	2,750%	-1,653%	-2,383%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,38
Rendimento lordo	-1,65272
Rendimento netto	-2,38270
Cedola in corso	2,75000
Rateo lordo	2,51644
Rateo netto	1,86216
Vita residua	0,08493
Duration modificata	0,08481
Convessità	0,09201
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	CNH Industrial Finance Europe
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	18/03/2014
Prezzo emissione	99,4710
Decorrenza prima cedola regolare	18/03/2014
Tasso annuale	2,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	18/03/2019
Data estinzione	18/03/2019
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	13/02/2019	100,2040	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,2200	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,2000	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	100,1980	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	100,4110	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,2000	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,3800	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	100,3750	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/03/2019	2,750	2,750	Certa	1.000.000.000	1.000.000.000	365