

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
105,62 EUR	CNH Industrial Finance Europe	27/09/2021	2,875%	0,698%	-0,048%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	105,615
Rendimento lordo	0,69786
Rendimento netto	-0,04787
Cedola in corso	2,87500
Rateo lordo	1,11062
Rateo netto	0,82186
Vita residua	2,61644
Duration modificata	2,51858
Convessità	8,97023
Cedola successiva	2,87500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

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	700.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	25/09/2014
Prezzo emissione	99,2200
Decorrenza prima cedola regolare	27/09/2015
Data Prorata	25/09/2014
Tasso annuale	2,8750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	27/09/2021
Data estinzione	27/09/2021
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	105,6150	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	105,5700	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	105,6200	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	106,0200	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	105,6350	EUR
Euro TLX	13/02/2019	106,0200	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	106,0200	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
27/09/2019	2,875	2,875	Certa	700.000.000	0	365
27/09/2020	2,875	2,875	Certa	700.000.000	0	366
27/09/2021	2,875	2,875	Certa	700.000.000	700.000.000	365