

NESTLE' HOLDINGS 1.875% 03/21 / XS1376845860
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Molto liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
98,14 USD	Nestle' Holdings INC	09/03/2021	1,875%	2,818%	2,302%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,14
Rendimento lordo	2,81831
Rendimento netto	2,30238
Cedola in corso	1,87500
Rateo lordo	1,75000
Rateo netto	1,29500
Vita residua	2,06301
Duration modificata	1,95234
Convessità	5,79549
Cedola successiva	1,87500
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Nestle' Holdings INC
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	550.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	09/03/2016
Prezzo emissione	99,5680
Decorrenza prima cedola regolare	09/03/2016
Tasso annuale	1,8750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30E/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	09/03/2021
Data estinzione	09/03/2021
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	98,2300	USD
Frankfurter Börse	12/02/2019	98,1600	USD
Börse Düsseldorf	12/02/2019	98,0300	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	98,1550	USD
Börse Berlin	12/02/2019	98,1500	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	98,0900	USD
Euro TLX	13/02/2019	98,1400	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
09/03/2019	1,875	1,875	Certa	550.000.000	0	365
09/03/2020	1,875	1,875	Certa	550.000.000	0	366
09/03/2021	1,875	1,875	Certa	550.000.000	550.000.000	365