

CNH INDUSTRIAL FIN. 2.875% 05/23 / XS1412424662
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
105,64 EUR	CNH Industrial Finance Europe	17/05/2023	2,875%	1,494%	0,746%


Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	105,64
Rendimento lordo	1,49407
Rendimento netto	0,74611
Cedola in corso	2,87500
Rateo lordo	2,15034
Rateo netto	1,59125
Vita residua	4,25479
Duration modificata	3,93418
Convessità	20,05394
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	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	17/05/2016
Prezzo emissione	99,2210
Decorrenza prima cedola regolare	17/05/2016
Tasso annuale	2,8750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	17/05/2023
Data estinzione	17/05/2023
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	105,6400	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	105,4800	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	105,6100	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	105,6100	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	105,9500	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	105,6100	EUR
Euro TLX	13/02/2019	105,9500	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	105,9550	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
17/05/2019	2,875	2,875	Certa	500.000.000	0	365
17/05/2020	2,875	2,875	Certa	500.000.000	0	366
17/05/2021	2,875	2,875	Certa	500.000.000	0	365
17/05/2022	2,875	2,875	Certa	500.000.000	0	365
17/05/2023	2,875	2,875	Certa	500.000.000	500.000.000	365