

CNH INDUSTRIAL FIN. 1.375% 05/22 / XS1616917800

Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Poco liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
101,01 EUR	CNH Industrial Finance Europe	23/05/2022	1,375%	1,057%	0,669%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	101,01
Rendimento lordo	1,05734
Rendimento netto	0,66908
Cedola in corso	1,37500
Rateo lordo	1,00959
Rateo netto	0,74710
Vita residua	3,26849
Duration modificata	3,15513
Convessità	13,25396
Cedola successiva	1,37500
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	CNH Industrial Finance Europe
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
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	23/05/2017
Prezzo emissione	99,3350
Decorrenza prima cedola regolare	23/05/2017
Tasso annuale	1,3750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	23/05/2022
Data estinzione	23/05/2022
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	12/02/2019	100,7400	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	100,7200	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	100,7400	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	100,7200	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	101,1000	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	100,6650	EUR
Euro TLX	13/02/2019	101,0100	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
23/05/2019	1,375	1,375	Certa	500.000.000	0	365
23/05/2020	1,375	1,375	Certa	500.000.000	0	366
23/05/2021	1,375	1,375	Certa	500.000.000	0	365
23/05/2022	1,375	1,375	Certa	500.000.000	500.000.000	365

Annotazioni

Callable fino al 22/02/2022 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 30 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	23/05/2017	22/02/2022	100	30
Call dal	23/02/2022	22/05/2022	100	30