Obbligazioni

CNH INDUSTRIAL FIN. 1.75% 09/25 / XS1678966935

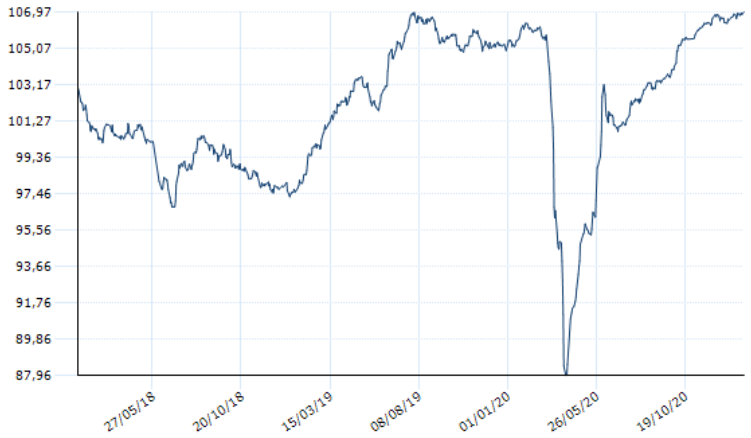
Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato

Grado Liquidità

Liquido

25/01/2021	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
106,97 EUR	CNH Industrial Finance Europe	12/09/2025	1,750%	0,233%	-0,227%



Analisi

Data ultima quotazione	25/01/2021
Data valutazione	25/01/2021
Data valuta	27/01/2021
Prezzo	106,97
Rendimento lordo	0,23273
Rendimento netto	-0,22704
Cedola in corso	1,75000
Rateo lordo	0,65685
Rateo netto	0,48607
Vita residua	4,62740
Duration modificata	4,45495
Convessità	24,74960
Cedola successiva	1,75000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	CNH Industrial Finance Europe
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	25/01/2021	106,9700	EUR
Börse Düsseldorf	25/01/2021	106,9700	EUR
Bayerische Börse	25/01/2021	106,9270	EUR
Börse Berlin	25/01/2021	106,8500	EUR
Börse Stuttgart	25/01/2021	106,9620	EUR
Euro TLX	26/01/2021	107,1100	EUR

Caratteristiche principali

Nominale circolante	650.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	12/09/2017
Prezzo emissione	99,2480
Decorrenza prima cedola regolare	12/09/2017
Tasso annuale	1,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	12/09/2025
Data estinzione	12/09/2025
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
12/09/2021	1,750	1,750	Certa	650.000.000	0	365
12/09/2022	1,750	1,750	Certa	650.000.000	0	365
12/09/2023	1,750	1,750	Certa	650.000.000	0	365
12/09/2024	1,750	1,750	Certa	650.000.000	0	366
12/09/2025	1,750	1,750	Certa	650.000.000	650.000.000	365

Annotazioni

Callable fino al 11/09/2025 con 'make-whole' premium legato
al Treasury Rate + 30 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	12/09/2017	11/06/2025	100	30
Call dal	12/06/2025	11/09/2025	100	30

Data 26/01/2021

Per presa visione .....

Scenari: In condizioni di mercato positive, ci si attende un incremento del prezzo dei titoli obbligazionari rispetto al prezzo di acquisto e la remunerazione dell'investimento attraverso la corresponsione delle cedole; in uno scenario di mercato negativo, è invece possibile che i titoli obbligazionari subiscano un decremento del prezzo rispetto al prezzo di acquisto e non garantiscano la corresponsione delle cedole.
Grado di rischio: L'indicatore di rischio SRRI del prodotto finanziario, qualora indicato come calcolato, si basa sulla volatilità a 3 anni dello strumento finanziario. Per i titoli obbligazionari quotati e non quotati viene stimata anche una componente rischio di credito sulla base dei valori di volatilità degli asset swap spreads calcolati, mediante una stima media su basket di titoli quotati suddivisi per gruppi omogenei di merito creditizio e per intervalli di scadenze temporali. Tale indicatore viene poi ripartito sulla base di 7 intervalli di rischio complessivo fissati a priori.
Il presente documento contiene informazioni sintetiche sulle caratteristiche e sui rischi principali dello strumento finanziario. Rappresenta, pertanto, uno strumento aggiuntivo e non sostitutivo del "Documento Informativo, Servizi di investimento, MIFID II", del prospetto informativo e degli altri documenti informativi ufficiali, che sono i documenti fondamentali cui fare riferimento per avere un'informazione completa su uno strumento finanziario. L'investitore deve considerare che la presente informativa, essendo redatta in un momento successivo alla stesura della documentazione ufficiale, contiene informazioni che possono differire rispetto a quelle indicate nella documentazione ufficiale. La presente informativa non costituisce attività di consulenza, né ricerca in materia di investimenti né rappresenta un appello al pubblico risparmio. Si sottolinea che ogni tipo di investimento comporta dei rischi, che i rendimenti si riferiscono al passato e che non vi è garanzia di ottenere uguali rendimenti per il futuro. I principali dati contenuti nel documento sono forniti da Analysis SpA, che, pur impegnandosi a verificarne l'accuratezza dei dati e delle informazioni pubblicate, non si assume alcuna responsabilità in merito alla effettiva correttezza.Conseguentemente, alcuna dichiarazione o garanzia, espressa o implicita, viene rilasciata circa la precisione, completezza o correttezza dei dati forniti.