

**ANGLOGOLD HOLDINGS 5.125% 08/22 / US03512TAC53**
**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 |
| 102,86 USD | Anglogold A Shanti Holdings | 01/08/2022 | 2,563%          | 4,273%           | 2,927%           |


**Analisi**

|                        |                   |
|------------------------|-------------------|
| Data ultima quotazione | 13/02/2019        |
| Data valutazione       | 13/02/2019        |
| Data valuta            | 15/02/2019        |
| Prezzo                 | 102,86            |
| Rendimento lordo       | 4,27264           |
| Rendimento netto       | 2,92719           |
| Cedola in corso        | 2,56250           |
| Rateo lordo            | 0,19931           |
| Rateo netto            | 0,14749           |
| Vita residua           | 3,46027           |
| Duration modificata    | 3,08167           |
| Convessità             | 12,89294          |
| Cedola successiva      | 2,56250           |
| Mercato di riferimento | Frankfurter Börse |

**Dati anagrafici principali**

|                   |                             |
|-------------------|-----------------------------|
| Ente emittente    | Anglogold A Shanti Holdings |
| Tipo obbligazione | Redeemable Bond             |
| Tipo tasso        | Tasso Fisso                 |
| Divisa            | USD                         |
| Convertibilità    | Nessuno                     |

**Caratteristiche principali**

|                                  |             |
|----------------------------------|-------------|
| Nominale circolante              | 750.000.000 |
| Nominale obbligazione            | 1.000,00    |
| Taglio minimo                    | 1.000,00    |
| Corso                            | Secco       |
| Sottoscrizione                   | Pro-rata    |
| Data emissione                   | 30/07/2012  |
| Prezzo emissione                 | 99,3980     |
| Decorrenza prima cedola regolare | 01/02/2013  |
| Data Prorata                     | 30/07/2012  |
| Tasso annuale                    | 5,1250      |
| Frequenza cedola                 | 2           |
| Base rateo cedola                | 30/360      |
| Subordinato                      | NO          |

**Rimborso**

|                             |                 |
|-----------------------------|-----------------|
| Tipo ammortamento           | Unica Soluzione |
| Data 1° rimborso            | 01/08/2022      |
| Data estinzione             | 01/08/2022      |
| 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 | 13/02/2019 | 102,8600 | USD    |
| Börse Düsseldorf  | 13/02/2019 | 102,8600 | USD    |
| Bayerische Börse  | 13/02/2019 | 102,8600 | USD    |
| Börse Berlin      | 13/02/2019 | 102,8600 | USD    |
| Börse Stuttgart   | 13/02/2019 | 102,8600 | USD    |

**Flusso cedolare**

| Data flusso | Tasso annuo % | Val. cedola | Tipo cedola | Val. residuo | Val. ammortato | Giorni |
|-------------|---------------|-------------|-------------|--------------|----------------|--------|
| 01/08/2019  | 5,125         | 2,563       | Certa       | 750.000.000  | 0              | 181    |
| 01/02/2020  | 5,125         | 2,563       | Certa       | 750.000.000  | 0              | 184    |
| 01/08/2020  | 5,125         | 2,563       | Certa       | 750.000.000  | 0              | 182    |
| 01/02/2021  | 5,125         | 2,563       | Certa       | 750.000.000  | 0              | 184    |
| 01/08/2021  | 5,125         | 2,563       | Certa       | 750.000.000  | 0              | 181    |
| 01/02/2022  | 5,125         | 2,563       | Certa       | 750.000.000  | 0              | 184    |
| 01/08/2022  | 5,125         | 2,563       | Certa       | 750.000.000  | 750.000.000    | 181    |

**Annotazioni**

Callable fino al 31/07/2022 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 50 bp.

**Call**

| Tipo     | Dal        | Al         | Valore | Giorni preavviso |
|----------|------------|------------|--------|------------------|
| Call dal | 30/07/2012 | 31/07/2022 | 100    | 30               |