

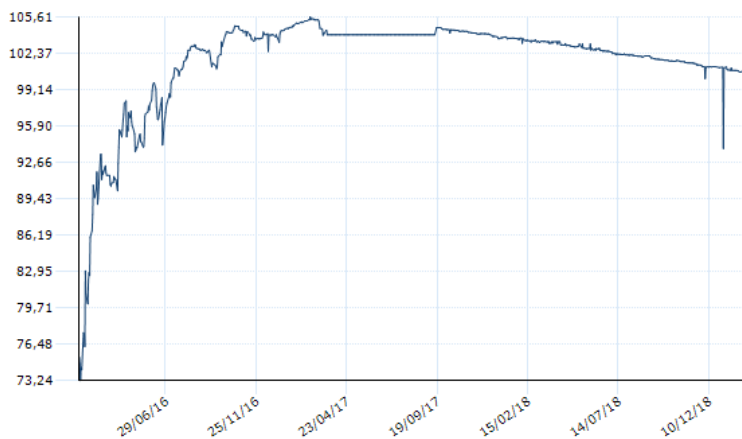
**ANGLO AMERICAN CAP 2.75% 06/19 / XS0789283792**
**Grado di rischio calcolato**

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
100,74 EUR	Anglo American Capital	07/06/2019	2,750%	0,325%	-0,365%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,74
Rendimento lordo	0,32517
Rendimento netto	-0,36453
Cedola in corso	2,75000
Rateo lordo	1,90616
Rateo netto	1,41056
Vita residua	0,30685
Duration modificata	0,30586
Convessità	0,39842
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	Anglo American Capital
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	750.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	07/06/2012
Prezzo emissione	99,9750
Decorrenza prima cedola regolare	07/06/2012
Tasso annuale	2,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	07/06/2019
Data estinzione	07/06/2019
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	100,1400	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	100,7400	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,7600	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,7400	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	100,7590	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	103,0150	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,7400	EUR

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
07/06/2019	2,750	2,750	Certa	750.000.000	750.000.000	365