

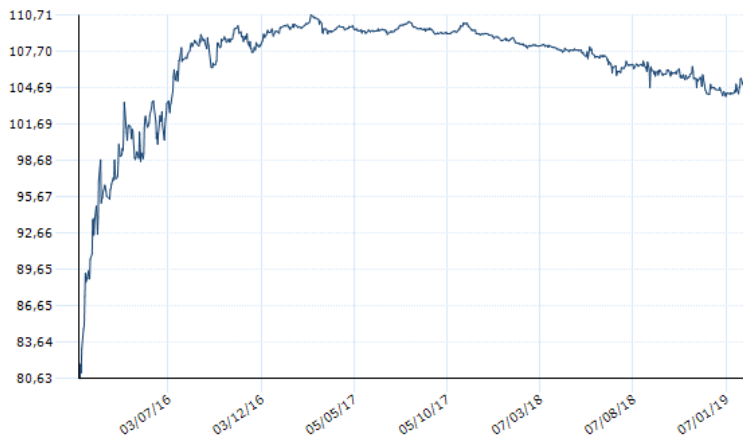
**GLENCORE FINANCE 3.375% 09/20 / XS0974877150**
**Grado di rischio calcolato**

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
104,76 EUR	Glencore Finance Europe	30/09/2020	3,375%	0,422%	-0,432%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	104,76
Rendimento lordo	0,42218
Rendimento netto	-0,43243
Cedola in corso	3,37500
Rateo lordo	1,27603
Rateo netto	0,94426
Vita residua	1,62466
Duration modificata	1,58613
Convessità	4,12591
Cedola successiva	3,37500
Mercato di riferimento	Euro TLX

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	Glencore Finance Europe
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	30/09/2013
Prezzo emissione	99,6510
Decorrenza prima cedola regolare	30/09/2013
Tasso annuale	3,3750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	30/09/2020
Data estinzione	30/09/2020
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	13/02/2019	104,7600	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	104,7700	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	104,7500	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	104,7500	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	104,7120	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	104,8900	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	104,7500	EUR
Euro TLX	13/02/2019	104,7600	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	104,8850	EUR

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
30/09/2019	3,375	3,375	Certa	750.000.000	0	365
30/09/2020	3,375	3,375	Certa	750.000.000	750.000.000	366