

GLENCORE FINANCE 3.75% 04/26 / XS1050842423
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
110,53 EUR	Glencore Finance Europe	01/04/2026	3,750%	2,138%	1,211%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	110,53
Rendimento lordo	2,13804
Rendimento netto	1,21069
Cedola in corso	3,75000
Rateo lordo	3,28767
Rateo netto	2,43288
Vita residua	7,12877
Duration modificata	6,11521
Convessità	46,92309
Cedola successiva	3,75000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Glencore 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	01/04/2014
Prezzo emissione	99,4310
Decorrenza prima cedola regolare	01/04/2014
Tasso annuale	3,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/04/2026
Data estinzione	01/04/2026
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	110,1500	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	110,0300	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	110,1500	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	110,1500	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	110,5000	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	110,5050	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	110,1000	EUR
Euro TLX	13/02/2019	110,5300	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/04/2019	3,750	3,750	Certa	500.000.000	0	365
01/04/2020	3,750	3,750	Certa	500.000.000	0	366
01/04/2021	3,750	3,750	Certa	500.000.000	0	365
01/04/2022	3,750	3,750	Certa	500.000.000	0	365
01/04/2023	3,750	3,750	Certa	500.000.000	0	365
01/04/2024	3,750	3,750	Certa	500.000.000	0	366
01/04/2025	3,750	3,750	Certa	500.000.000	0	365
01/04/2026	3,750	3,750	Certa	500.000.000	500.000.000	365

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	01/01/2026	31/03/2026	100	30