

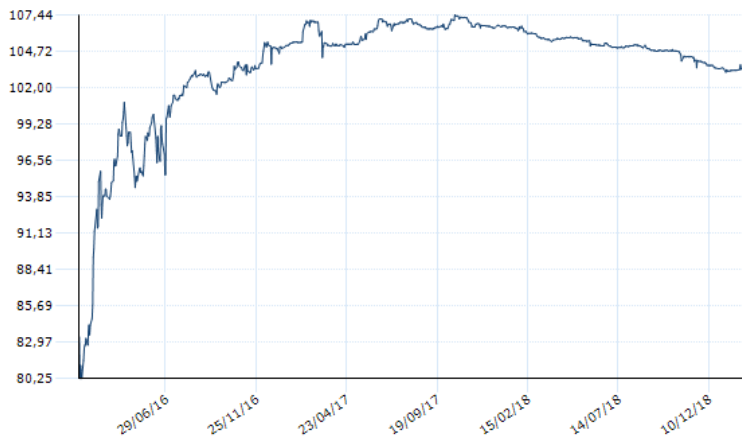
**ARCELORMITTAL 2.875% 07/20 / XS1084568762**
**Grado di rischio calcolato**

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
103,34 EUR	Arcelormittal	06/07/2020	2,875%	0,451%	-0,308%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	103,34
Rendimento lordo	0,45068
Rendimento netto	-0,30771
Cedola in corso	2,87500
Rateo lordo	1,76438
Rateo netto	1,30564
Vita residua	1,38904
Duration modificata	1,35570
Convessità	3,21372
Cedola successiva	2,87500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	Arcelormittal
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	600.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	04/07/2014
Prezzo emissione	99,1820
Decorrenza prima cedola regolare	06/07/2015
Data Prorata	04/07/2014
Tasso annuale	2,8750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	06/07/2020
Data estinzione	06/07/2020
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	103,3400	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	103,3900	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	103,3400	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	103,3700	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	103,6260	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	103,3800	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	103,3500	EUR
Euro TLX	13/02/2019	103,5800	EUR

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
06/07/2019	2,875	2,875	Certa	600.000.000	0	365
06/07/2020	2,875	2,875	Certa	600.000.000	600.000.000	366