

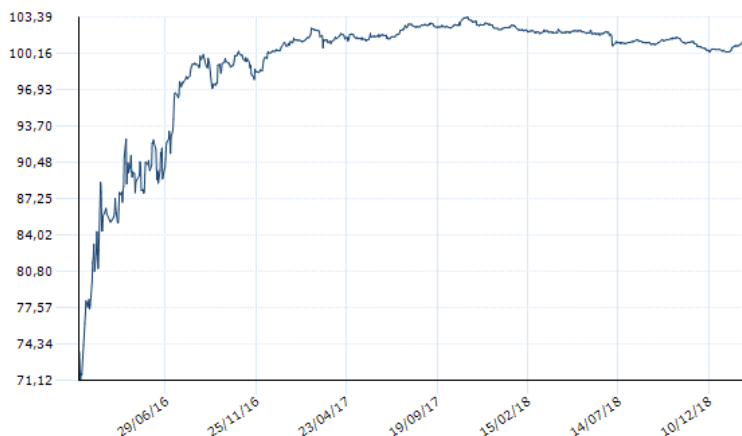
GLENCORE FINANCE 1.25% 03/21 / XS1202846819
Grado di rischio calcolato

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
101,19 EUR	Glencore Finance Europe	17/03/2021	1,250%	0,674%	0,339%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	101,185
Rendimento lordo	0,67390
Rendimento netto	0,33942
Cedola in corso	1,25000
Rateo lordo	1,14726
Rateo netto	0,84897
Vita residua	2,08493
Duration modificata	2,03468
Convessità	6,21980
Cedola successiva	1,25000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Glencore Finance Europe
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.250.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	17/03/2015
Prezzo emissione	99,6960
Decorrenza prima cedola regolare	17/03/2015
Tasso annuale	1,2500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	17/03/2021
Data estinzione	17/03/2021
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	101,1850	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	101,2900	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	101,2400	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	101,2700	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	101,3800	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	101,3140	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	101,2400	EUR
Euro TLX	13/02/2019	101,2900	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
17/03/2019	1,250	1,250	Certa	1.250.000.000	0	365
17/03/2020	1,250	1,250	Certa	1.250.000.000	0	366
17/03/2021	1,250	1,250	Certa	1.250.000.000	1.250.000.000	365

Call

Call dal	Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
17/12/2020		16/03/2021	100		30