

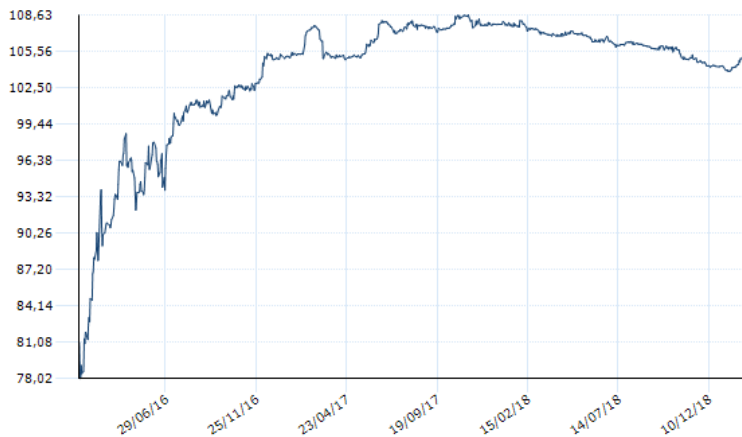
ARCELORMITTAL 3.00% 04/21 / XS1214673722
Grado di rischio calcolato

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
104,71 EUR	Arcelormittal	09/04/2021	3,000%	0,778%	0,007%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	104,705
Rendimento lordo	0,77813
Rendimento netto	0,00682
Cedola in corso	3,00000
Rateo lordo	2,56438
Rateo netto	1,89764
Vita residua	2,14795
Duration modificata	2,04834
Convessità	6,35894
Cedola successiva	3,00000
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	500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	09/04/2015
Prezzo emissione	99,5460
Decorrenza prima cedola regolare	09/04/2015
Tasso annuale	3,0000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	09/04/2021
Data estinzione	09/04/2021
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	104,7050	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	104,8900	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	104,8800	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	104,8800	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	105,1500	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	105,1050	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	104,8600	EUR
Euro TLX	13/02/2019	105,0000	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
09/04/2019	3,000	3,000	Certa	500.000.000	0	365
09/04/2020	3,000	3,000	Certa	500.000.000	0	366
09/04/2021	3,000	3,000	Certa	500.000.000	500.000.000	365