

GENERAL ELEC CAP UsdLib3m 05/26 / US36962GW752
Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Grado Liquidità

Molto liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
87,94 USD	General Electric Capital Corp	05/05/2026	0,778%	5,245%	4,338%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	87,94
Rendimento lordo	5,24502
Rendimento netto	4,33817
Cedola in corso	0,77820
Rateo lordo	0,08646
Rateo netto	0,06398
Vita residua	7,22192
Duration modificata	0,23330
Convessità	0,28774
Cedola successiva	0,78400
Mercato di riferimento	Börse Düsseldorf

Dati anagrafici principali

Ente emittente	General Electric Capital Corp
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	950.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regolar
Data emissione	05/05/2006
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	05/05/2006
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	05/05/2026
Data estinzione	05/05/2026
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	87,8900	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	87,9400	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	88,0600	USD
Börse Berlin	13/02/2019	86,0000	USD
ExtraMOT	13/02/2019	87,9200	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	88,0600	USD
Euro TLX	13/02/2019	88,4400	USD
Hi-MTF	13/02/2019	89,3750	USD

Formula di indicizzazione

$$TV = (\text{USDLibor3m} + 0.38) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg).}$$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
06/05/2019	0,000	0,778	Certa	950.000.000	0	90
05/08/2019	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	91
05/11/2019	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	92
05/02/2020	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	92
05/05/2020	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	90
05/08/2020	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	92
05/11/2020	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	92
05/02/2021	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	92
05/05/2021	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	89
05/08/2021	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	92
05/11/2021	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	92
07/02/2022	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	94
05/05/2022	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	87
05/08/2022	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	92
07/11/2022	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	94
06/02/2023	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	91
05/05/2023	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	88
07/08/2023	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	94
06/11/2023	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	0	91
.....						
05/05/2026	0,000	0,784	Prevista	950.000.000	950.000.000	89

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
05/05/2006	05/05/2026	USDLIBOR3M	1,000	0,380

Data 14/02/2019

Per presa visione

