

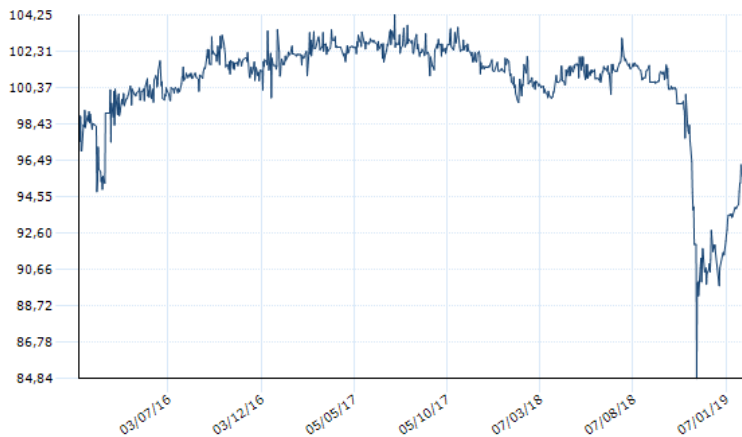
GENERAL ELEC CAP UsdLib3m 03/23 / US36966THT25
Grado di rischio calcolato

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
96,85 USD	General Electric Capital Corp	15/03/2023	0,926%	4,706%	3,677%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	96,85
Rendimento lordo	4,70641
Rendimento netto	3,67657
Cedola in corso	0,92600
Rateo lordo	0,63136
Rateo netto	0,46721
Vita residua	4,07945
Duration modificata	0,06472
Convessità	0,06891
Cedola successiva	0,94400
Mercato di riferimento	Euro TLX

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	615.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	14/03/2013
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	15/06/2013
Data Prorata	14/03/2013
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/03/2023
Data estinzione	15/03/2023
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	96,1900 USD
Börse Berlin	13/02/2019	95,4520 USD
Euro TLX	13/02/2019	96,8500 USD

Formula di indicizzazione
 $TV = (\text{USDLibor } 3m + 1,00) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg)}$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/03/2019	0,000	0,926	Certa	615.000.000	0	88
17/06/2019	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	94
16/09/2019	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	91
16/12/2019	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	91
16/03/2020	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	91
15/06/2020	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	91
15/09/2020	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	92
15/12/2020	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	91
15/03/2021	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	90
15/06/2021	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	92
15/09/2021	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	92
15/12/2021	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	91
15/03/2022	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	90
15/06/2022	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	92
15/09/2022	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	92
15/12/2022	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	0	91
15/03/2023	0,000	0,944	Prevista	615.000.000	615.000.000	90

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
14/03/2013	15/03/2023	USDLIBOR3M	1,000	1,000