

GLAXOSMITHKLINE CAP 4.00% 06/25 / XS0222383027
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
120,34 EUR	GlaxoSmithKline Capital	16/06/2025	4,000%	0,703%	-0,245%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	120,34
Rendimento lordo	0,70298
Rendimento netto	-0,24450
Cedola in corso	4,00000
Rateo lordo	2,67397
Rateo netto	1,97874
Vita residua	6,33699
Duration modificata	5,62372
Convessità	39,65409
Cedola successiva	4,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	750.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	16/06/2005
Prezzo emissione	98,4400
Decorrenza prima cedola regolare	16/06/2005
Tasso annuale	4,0000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	16/06/2025
Data estinzione	16/06/2025
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	113,7500	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	120,4700	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	120,5600	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	120,5200	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	120,5800	EUR
Euro TLX	13/02/2019	120,3400	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	120,7850	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
16/06/2019	4,000	4,000	Certa	750.000.000	0	365
16/06/2020	4,000	4,000	Certa	750.000.000	0	366
16/06/2021	4,000	4,000	Certa	750.000.000	0	365
16/06/2022	4,000	4,000	Certa	750.000.000	0	365
16/06/2023	4,000	4,000	Certa	750.000.000	0	365
16/06/2024	4,000	4,000	Certa	750.000.000	0	366
16/06/2025	4,000	4,000	Certa	750.000.000	750.000.000	365