

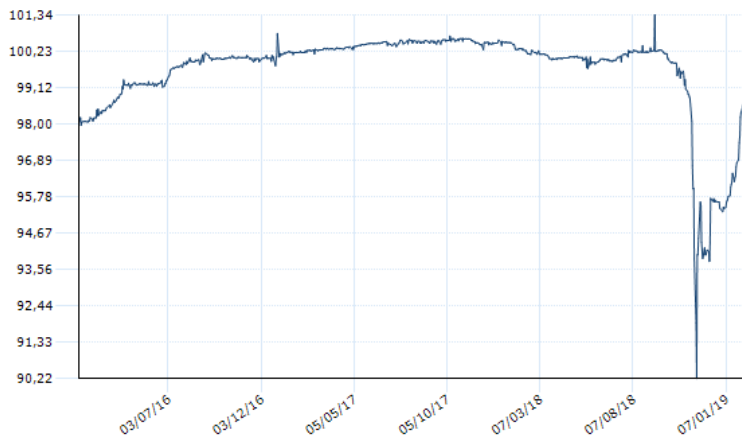
GE CAPITAL FUNDING Eurib3m 05/21 / XS0254356057
Grado di rischio calcolato

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
98,58 EUR	GE Capital European Funding	17/05/2021	0,000%	0,637%	0,632%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,58
Rendimento lordo	0,63708
Rendimento netto	0,63224
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	2,25205
Duration modificata	0,02018
Convessità	0,02058
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	GE Capital European Funding
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	17/05/2006
Prezzo emissione	99,6980
Decorrenza prima cedola regolare	17/05/2006
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	17/05/2021
Data estinzione	17/05/2021
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	98,0680	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	97,0500	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	98,2800	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	97,0500	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	98,4100	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	98,2600	EUR
Euro TLX	13/02/2019	98,5800	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	98,4300	EUR

Formula di indicizzazione

$$TV = (\text{Euribor3m} + 0,225) * \text{Act}/360 \text{ (Puntuale 2gg.)}$$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/02/2019	0,000	0,000	Certa	1.000.000.000	0	91
17/05/2019	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	0	88
19/08/2019	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	0	94
18/11/2019	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	0	91
17/02/2020	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	0	91
18/05/2020	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	0	91
17/08/2020	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	0	91
17/11/2020	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	0	92
17/02/2021	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	0	92
17/05/2021	0,000	0,000	Prevista	1.000.000.000	1.000.000.000	89

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
17/05/2006	17/05/2021	EURIBOR3M	1,000	0,225