

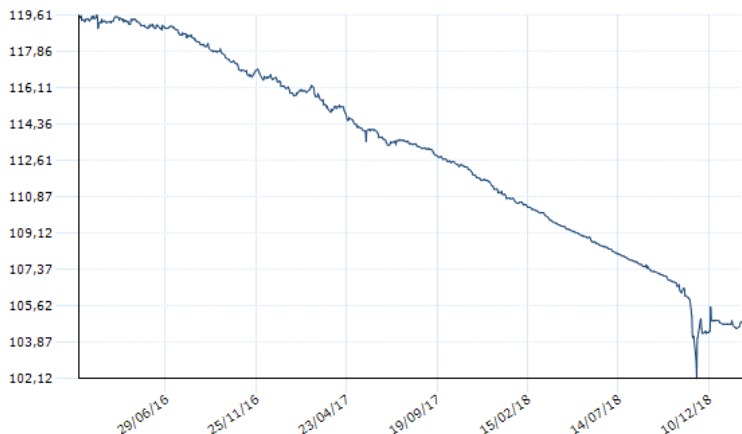
GE CAPITAL FUNDING 5.375% 01/20 / XS0453908377
Grado di rischio calcolato

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
104,6 EUR	GE Capital European Funding	23/01/2020	5,375%	0,438%	-0,894%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	104,6
Rendimento lordo	0,43765
Rendimento netto	-0,89403
Cedola in corso	5,37500
Rateo lordo	0,33870
Rateo netto	0,25064
Vita residua	0,93699
Duration modificata	0,93296
Convessità	1,79925
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.500.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	23/09/2009
Prezzo emissione	99,3200
Decorrenza prima cedola regolare	23/01/2011
Data Prorata	23/09/2009
Tasso annuale	5,3750
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	23/01/2020
Data estinzione	23/01/2020
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	120,2000	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	104,6000	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	104,6200	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	104,5900	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	104,6000	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	104,3770	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	104,5800	EUR
Euro TLX	13/02/2019	104,8000	EUR
Hi-MTF	13/02/2019	104,8000	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
23/01/2020	5,375	5,375	Certa	1.500.000.000	1.500.000.000	365