

GENERAL ELEC CAP COR 2.50% 03/20 / XS1042118106
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Altamente liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
98,85 USD	General Electric Capital Corp	28/03/2020	1,250%	3,583%	2,910%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,85
Rendimento lordo	3,58336
Rendimento netto	2,90965
Cedola in corso	1,25000
Rateo lordo	0,95139
Rateo netto	0,70403
Vita residua	1,11507
Duration modificata	1,06374
Convessità	2,17282
Cedola successiva	1,25000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	505.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	28/03/2014
Prezzo emissione	99,7600
Decorrenza prima cedola regolare	28/03/2014
Tasso annuale	2,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30E/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	28/03/2020
Data estinzione	28/03/2020
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	98,8500	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	98,7300	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	98,8900	USD
Börse Berlin	13/02/2019	98,9190	USD
EuroMOT	13/02/2019	99,0000	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	98,8500	USD
Euro TLX	13/02/2019	99,0700	USD
Hi-MTF	13/02/2019	98,9500	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
28/03/2019	2,500	1,250	Certa	505.000.000	0	181
28/09/2019	2,500	1,250	Certa	505.000.000	0	184
28/03/2020	2,500	1,250	Certa	505.000.000	505.000.000	182