

**GENERAL ELEC CAP UsdLib3m 03/20 / XS1042118288**
**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
98,98 USD	General Electric Capital Corp	28/03/2020	0,803%	4,168%	3,317%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,976
Rendimento lordo	4,16783
Rendimento netto	3,31684
Cedola in corso	0,80340
Rateo lordo	0,43738
Rateo netto	0,32366
Vita residua	1,11507
Duration modificata	0,10792
Convessità	0,11957
Cedola successiva	0,79530
Mercato di riferimento	Börse Berlin

**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	245.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	28/03/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	28/03/2014
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/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	99,0720	USD
Börse Berlin	13/02/2019	98,9760	USD
EuroMOT	13/02/2019	99,7210	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	99,3700	USD
Euro TLX	13/02/2019	99,6900	USD
Hi-MTF	13/02/2019	99,9550	USD

**Formula di indicizzazione**
 $TV = (\text{USDlibor } 3m + 0.41) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale 2gg)}$ 
**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
28/03/2019	0,000	0,803	Certa	245.000.000	0	90
28/06/2019	0,000	0,795	Prevista	245.000.000	0	92
30/09/2019	0,000	0,795	Prevista	245.000.000	0	94
30/12/2019	0,000	0,795	Prevista	245.000.000	0	91
28/03/2020	0,000	0,795	Prevista	245.000.000	245.000.000	91

**Indicizzazione cedole**

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
28/03/2014	28/03/2020	USDLIBOR3M	1,000	0,410