

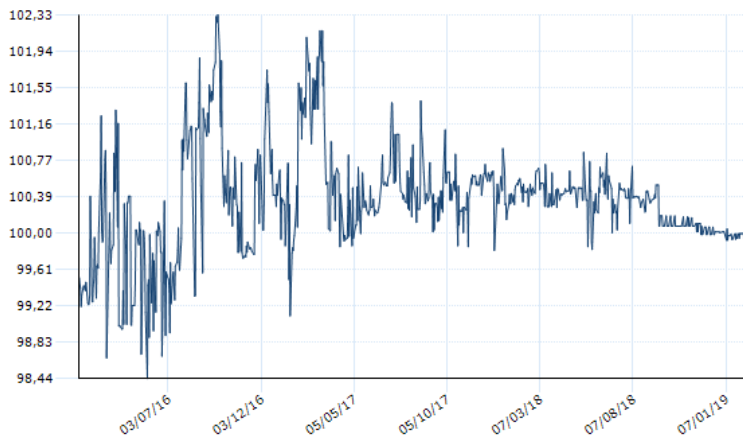
TOTAL CAPITAL INT GBPLib3m 07/19 / XS1082839553
Grado di rischio calcolato

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
100 GBP	Total Capital International	01/07/2019	0,295%	1,212%	0,885%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100
Rendimento lordo	1,21241
Rendimento netto	0,88508
Cedola in corso	0,29500
Rateo lordo	0,14226
Rateo netto	0,10527
Vita residua	0,37260
Duration modificata	0,12216
Convessità	0,13708
Cedola successiva	0,30500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Total Capital International
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	GBP
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	275.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	01/07/2014
Prezzo emissione	99,7560
Decorrenza prima cedola regolare	01/07/2014
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/365
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	01/07/2019
Data estinzione	01/07/2019
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	100,0000	GBP
NYSE Euronext Paris	13/02/2019	99,7560	GBP
LSE London Stock Exchange	13/02/2019	100,0000	GBP

Formula di indicizzazione

$$TV = (GBPLibor\ 3m + 0.30) * act/365 \text{ (puntuale 2gg).}$$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/04/2019	0,000	0,295	Certa	275.000.000	0	89
01/07/2019	0,000	0,305	Prevista	275.000.000	275.000.000	91

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
01/07/2014	01/07/2019	GBPLIBOR3M	1,000	0,300