

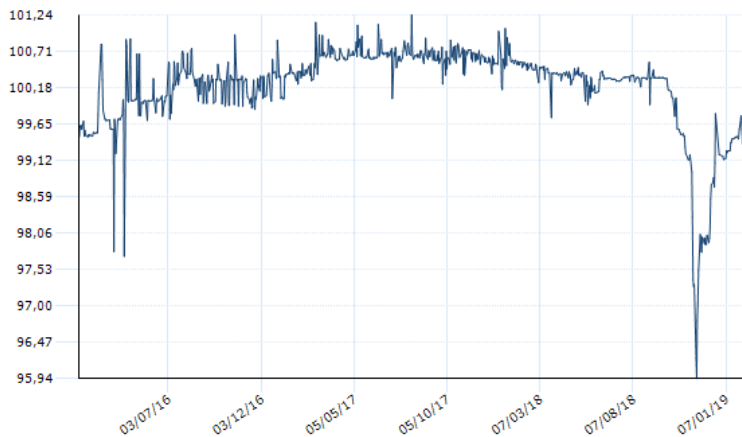
GE CAPITAL FUNDING Eurib3m 01/20 / XS1169331367
Grado di rischio calcolato

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
99,66 EUR	GE Capital European Funding	21/01/2020	0,018%	0,436%	0,417%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,66
Rendimento lordo	0,43613
Rendimento netto	0,41665
Cedola in corso	0,01840
Rateo lordo	0,00500
Rateo netto	0,00370
Vita residua	0,93151
Duration modificata	0,17934
Convessità	0,21151
Cedola successiva	0,01900
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	850.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	100.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	21/01/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	21/01/2015
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	21/01/2020
Data estinzione	21/01/2020
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	99,6500	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	99,6900	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	99,6600	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	99,6700	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	95,3450	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	99,6600	EUR
Euro TLX	13/02/2019	99,6600	EUR

Formula di indicizzazione
 $TV = (\text{Euribor3m} + 0.38) \cdot \text{act}/360$ (puntuale 2gg).

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
23/04/2019	0,000	0,018	Certa	850.000.000	0	92
22/07/2019	0,000	0,019	Prevista	850.000.000	0	90
21/10/2019	0,000	0,019	Prevista	850.000.000	0	91
21/01/2020	0,000	0,019	Prevista	850.000.000	850.000.000	92

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
21/01/2015	21/01/2020	EURIBOR3M	1,000	0,380