

DEUTSCHE FIN BV Cms30a 06/19 / DE0003083358

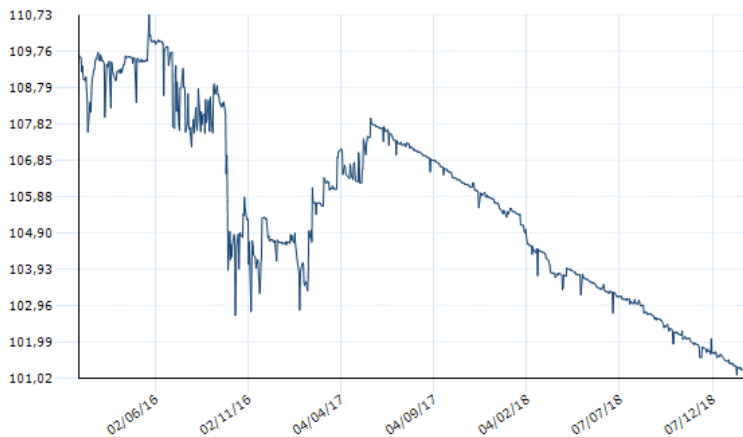
Grado di rischio calcolato

| | | | | | | | | |
|-------------------|---|---|---|---|---|---|---|-----------------|
| 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 |
| 101,09 EUR | Deutsche Finance (Netherlands) | 04/06/2019 | 4,000% | 0,332% | -0,660% |


Analisi

| | |
|------------------------|------------|
| Data ultima quotazione | 13/02/2019 |
| Data valutazione | 13/02/2019 |
| Data valuta | 15/02/2019 |
| Prezzo | 101,09 |
| Rendimento lordo | 0,33226 |
| Rendimento netto | -0,65965 |
| Cedola in corso | 4,00000 |
| Rateo lordo | 2,80548 |
| Rateo netto | 2,07605 |
| Vita residua | 0,29863 |
| Duration modificata | 0,29765 |
| Convessità | 0,38525 |
| Cedola successiva | 0,00000 |
| Mercato di riferimento | Euro TLX |

Dati anagrafici principali

| | |
|-------------------|--------------------------------|
| Ente emittente | Deutsche Finance (Netherlands) |
| Tipo obbligazione | Interest Rate Linked |
| Tipo tasso | Tasso Variabile |
| Divisa | EUR |
| Convertibilità | Nessuno |

Caratteristiche principali

| | |
|----------------------------------|-------------|
| Nominale circolante | 400.000.000 |
| Nominale obbligazione | 1.000,00 |
| Taglio minimo | 1.000,00 |
| Corso | Secco |
| Sottoscrizione | Regular |
| Data emissione | 04/06/1999 |
| Prezzo emissione | 101,4500 |
| Decorrenza prima cedola regolare | 04/06/1999 |
| Frequenza cedola | 1 |
| Base rateo cedola | ACT/ACT |
| Cedola minima % | 4,00 |
| Subordinato | NO |

Rimborso

| | |
|-----------------------------|-----------------|
| Tipo ammortamento | Unica Soluzione |
| Data 1° rimborso | 04/06/2019 |
| Data estinzione | 04/06/2019 |
| 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 | 99,5200 | EUR |
| Bayerische Börse | 13/02/2019 | 99,5300 | EUR |
| Börse Berlin | 13/02/2019 | 100,3420 | EUR |
| Bourse de Luxembourg | 13/02/2019 | 100,1790 | EUR |
| Euro TLX | 13/02/2019 | 101,0900 | EUR |

Formula di indicizzazione

$$TV = (82\% * CMSEUR30a) * act/act \text{ (puntuale 2gg)}$$
Flusso cedolare

| Data | flusso | Tasso annuo % | Val. cedola | Tipo cedola | Val. residuo | Val. ammortato | Giorni |
|------------|--------|---------------|-------------|-------------|--------------|----------------|--------|
| 04/06/2019 | 0,000 | 4,000 | Certa | 400.000.000 | 400.000.000 | 365 | |

Indicizzazione cedole

| Da | A | Descrizione indice | Peso | Spread |
|------------|------------|--------------------|-------|--------|
| 04/06/1999 | 04/06/2019 | IRS30YEUR | 0,820 | 0,000 |