

DEUTSCHE B.(LB) 3.70% 05/24 / US25152RXA66
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
95 USD	Deutsche Bank London	30/05/2024	1,850%	4,838%	3,818%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	95
Rendimento lordo	4,83782
Rendimento netto	3,81825
Cedola in corso	1,85000
Rateo lordo	0,77083
Rateo netto	0,57042
Vita residua	5,29041
Duration modificata	4,57993
Convessità	26,71473
Cedola successiva	1,85000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Deutsche Bank London
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.600.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	30/05/2014
Prezzo emissione	99,6190
Decorrenza prima cedola regolare	30/05/2014
Tasso annuale	3,7000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	30/05/2024
Data estinzione	30/05/2024
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	95,0000	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	93,4800	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	93,4600	USD
Börse Berlin	13/02/2019	93,5500	USD
ExtraMOT	13/02/2019	94,4000	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	93,8600	USD
Euro TLX	13/02/2019	94,5500	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
30/05/2019	3,700	1,850	Certa	1.600.000.000	0	181
30/11/2019	3,700	1,850	Certa	1.600.000.000	0	184
30/05/2020	3,700	1,850	Certa	1.600.000.000	0	182
30/11/2020	3,700	1,850	Certa	1.600.000.000	0	184
30/05/2021	3,700	1,850	Certa	1.600.000.000	0	181
30/11/2021	3,700	1,850	Certa	1.600.000.000	0	184
30/05/2022	3,700	1,850	Certa	1.600.000.000	0	181
30/11/2022	3,700	1,850	Certa	1.600.000.000	0	184
30/05/2023	3,700	1,850	Certa	1.600.000.000	0	181
30/11/2023	3,700	1,850	Certa	1.600.000.000	0	184
30/05/2024	3,700	1,850	Certa	1.600.000.000	1.600.000.000	182