

**ROYAL BANK OF CANADA 2.15% 03/20 / US78012KCB17**
**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
99,27 USD	Royal Bank of Canada	06/03/2020	1,075%	2,885%	2,309%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,27
Rendimento lordo	2,88473
Rendimento netto	2,30902
Cedola in corso	1,07500
Rateo lordo	0,94958
Rateo netto	0,70269
Vita residua	1,05479
Duration modificata	1,00966
Convessità	2,01319
Cedola successiva	1,07500
Mercato di riferimento	Börse Berlin

**Dati anagrafici principali**

Ente emittente	Royal Bank of Canada
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	850.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	06/03/2015
Prezzo emissione	99,9010
Decorrenza prima cedola regolare	06/03/2015
Tasso annuale	2,1500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	06/03/2020
Data estinzione	06/03/2020
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	99,2700	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	99,2700	USD
Börse Berlin	13/02/2019	99,2700	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	99,2700	USD

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
06/03/2019	2,150	1,075	Certa	850.000.000	0	181
06/09/2019	2,150	1,075	Certa	850.000.000	0	184
06/03/2020	2,150	1,075	Certa	850.000.000	850.000.000	182