

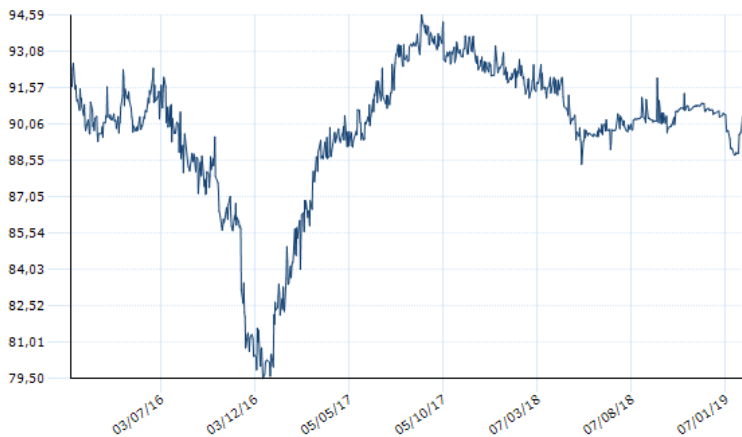
DEUTSCHE B.(LB) USDLibor3m 07/25 / XS0461387168
Grado di rischio calcolato

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
89,84 USD	Deutsche Bank London	08/07/2025	0,750%	4,677%	3,892%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	89,84
Rendimento lordo	4,67653
Rendimento netto	3,89225
Cedola in corso	0,75000
Rateo lordo	0,30833
Rateo netto	0,22817
Vita residua	6,39726
Duration modificata	0,00313
Convessità	0,00314
Cedola successiva	0,75000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Deutsche Bank London
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Euro TLX	13/02/2019	89,8400	USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	100.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	08/07/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	08/07/2015
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30/360
Cedola minima %	0,28
Cedola massima %	1,13
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	08/07/2025
Data estinzione	08/07/2025
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Formula di indicizzazione

Primi 4 anni tasso fisso trimestrale dello 0.75%. Poi:
 $TV = (\text{USDLibor } 3m) / 4$ (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
08/04/2019	3,000	0,750	Certa	100.000.000	0	90
08/07/2019	3,000	0,750	Certa	100.000.000	0	91
08/10/2019	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	92
08/01/2020	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	92
08/04/2020	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	91
08/07/2020	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	91
08/10/2020	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	92
08/01/2021	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	92
08/04/2021	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	90
08/07/2021	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	91
08/10/2021	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	92
08/01/2022	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	92
08/04/2022	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	90
08/07/2022	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	91
08/10/2022	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	92
08/01/2023	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	92
08/04/2023	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	90
08/07/2023	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	91
08/10/2023	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	0	92
.....						
08/07/2025	0,000	0,684	Prevista	100.000.000	100.000.000	91

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
08/07/2019	08/07/2025	USDLIBOR3M	1,000	0,000