

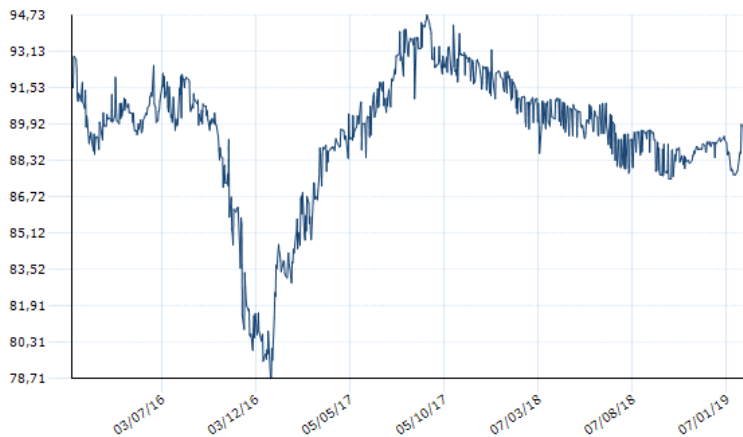
DEUTSCHE B.(LB) CMSUSD10a 07/25 / XS0461387325
Grado di rischio calcolato

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
89,15 USD	Deutsche Bank London	15/07/2025	3,000%	4,772%	4,000%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	89,15
Rendimento lordo	4,77233
Rendimento netto	4,00024
Cedola in corso	3,00000
Rateo lordo	1,75000
Rateo netto	1,29500
Vita residua	6,41644
Duration modificata	0,06830
Convessità	0,07296
Cedola successiva	2,75400
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	89,1500 USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	37.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/07/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	15/07/2015
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/07/2025
Data estinzione	15/07/2025
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 annuale del 3.00%. Poi:
 $TV = (CMSUSD10a) \text{ (puntuale 2gg)}$

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/07/2019	3,000	3,000	Certa	37.000.000	0	365
15/07/2020	0,000	2,754	Prevista	37.000.000	0	366
15/07/2021	0,000	2,754	Prevista	37.000.000	0	365
15/07/2022	0,000	2,754	Prevista	37.000.000	0	365
15/07/2023	0,000	2,754	Prevista	37.000.000	0	365
15/07/2024	0,000	2,754	Prevista	37.000.000	0	366
15/07/2025	0,000	2,754	Prevista	37.000.000	37.000.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/07/2019	15/07/2025	IRS10YUSD	1,000	0,000