

GOVT 15/05/13-43 2.875% / US912810RB61

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
97,78 USD	United States of America	15/05/2043	1,438%	3,025%	2,651%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,78
Rendimento lordo	3,02491
Rendimento netto	2,65065
Cedola in corso	1,43750
Rateo lordo	0,73066
Rateo netto	0,63933
Vita residua	24,26027
Duration modificata	16,90809
Convessità	368,41259
Cedola successiva	1,43750
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	United States of America
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	42.000.000.000
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	100,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/05/2013
Prezzo emissione	97,9272
Decorrenza prima cedola regolare	15/05/2013
Tasso annuale	2,8750
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/05/2043
Data estinzione	15/05/2043
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 12,5%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Frankfurter Börse	13/02/2019	97,8500	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	97,6490	USD
Börse Berlin	13/02/2019	97,6900	USD
ExtraMOT	13/02/2019	98,0100	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	97,7700	USD
Euro TLX	13/02/2019	97,7800	USD
Hi-MTF	13/02/2019	97,7970	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/05/2019	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	181
15/11/2019	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	184
15/05/2020	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	182
15/11/2020	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	184
15/05/2021	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	181
15/11/2021	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	184
15/05/2022	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	181
15/11/2022	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	184
15/05/2023	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	181
15/11/2023	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	184
15/05/2024	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	182
15/11/2024	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	184
15/05/2025	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	181
15/11/2025	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	184
15/05/2026	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	181
15/11/2026	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	184
15/05/2027	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	181
15/11/2027	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	184
15/05/2028	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	0	182
.....						
15/05/2043	2,875	1,438	Certa	42.000.000.000	42.000.000.000	181