

US TREASURY NOTE 2.875% 05/28 / US9128284N73
Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Grado Liquidità

Molto liquido

12/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
101,61 USD	United States of America	15/05/2028	1,438%	2,692%	2,332%


Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	101,614
Rendimento lordo	2,69248
Rendimento netto	2,33226
Cedola in corso	1,43750
Rateo lordo	0,72272
Rateo netto	0,63238
Vita residua	9,25479
Duration modificata	7,93263
Convessità	76,10161
Cedola successiva	1,43750
Mercato di riferimento	Bayerische Börse

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	75.027.000.000
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	100,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/05/2018
Prezzo emissione	100,1318
Decorrenza prima cedola regolare	15/05/2018
Tasso annuale	2,8750
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/05/2028
Data estinzione	15/05/2028
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	12/02/2019	101,6500	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	101,6140	USD
Börse Berlin	12/02/2019	101,6800	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	101,6100	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/05/2019	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	181
15/11/2019	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	184
15/05/2020	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	182
15/11/2020	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	184
15/05/2021	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	181
15/11/2021	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	184
15/05/2022	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	181
15/11/2022	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	184
15/05/2023	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	181
15/11/2023	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	184
15/05/2024	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	182
15/11/2024	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	184
15/05/2025	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	181
15/11/2025	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	184
15/05/2026	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	181
15/11/2026	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	184
15/05/2027	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	181
15/11/2027	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	0	184
15/05/2028	2,875	1,438	Certa	75.027.000.000	75.027.000.000	182