

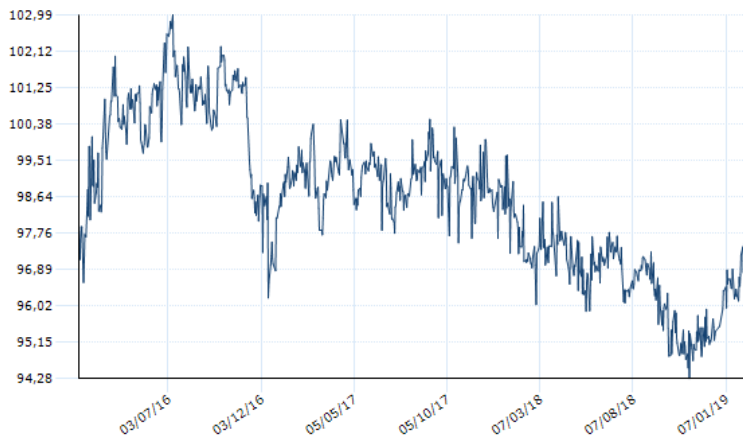
US TIPS 15/01/15-25 0.25% / US912828H458
Grado di rischio calcolato

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
97,2 USD	United States of America	15/01/2025	0,125%	2,931%	2,888%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,2
Rendimento lordo	2,93126
Rendimento netto	2,88762
Cedola in corso	0,12500
Rateo lordo	0,02141
Rateo netto	0,01873
Vita residua	5,92055
Duration modificata	2,51417
Convessità	8,43277
Cedola successiva	0,12500
Coefficiente di inflazione	1,06241
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	United States of America
Tipo obbligazione	Inflation Linked
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	28.000.000.000
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	100,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/01/2015
Prezzo emissione	99,1029
Decorrenza prima cedola regolare	15/01/2015
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/01/2025
Data estinzione	15/01/2025
Base rateo capitale	Composta
Indicizzazione sul capitale	Si
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 12,5%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore Valuta
Euro TLX	13/02/2019	97,2000 USD

Formula di indicizzazione

Buono del Tesoro Poliennale legato all'Inflazione Americana.
 Cedole= 0.125 * VN * IRi/IR0

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni	Annotazioni
15/07/2019	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	0	181	Dove:
15/01/2020	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	0	184	VN : Valore nominale dell'obbligazione
15/07/2020	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	0	182	IR : Inflazione di Riferimento
15/01/2021	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	0	184	IR0 : Inflazione di Riferimento iniziale
15/07/2021	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	0	181	IRi : IRm-3 + (d-1)/D * (IRm-2 - IRm-3)
15/01/2022	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	0	184	m : mese di riferimento
15/07/2022	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	0	181	d : giorno di riferimento
15/01/2023	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	0	184	D : n. giorni del mese m
15/07/2023	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	0	181	Rimborso= VN*Max [1; IRf/IR0]
15/01/2024	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	0	184	IRf : Inflazione di Riferimento alla data di scadenza
15/07/2024	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	0	182	
15/01/2025	0,250	0,125	Prevista	28.000.000.000	28.000.000.000	184	

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/01/2015	15/01/2025	CPI Stati Uniti	1,000	0,000