

US TIPS 15/01/10-20 1.375% / US912828MF47

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
100,71 USD	United States of America	15/01/2020	0,688%	2,777%	2,599%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,71
Rendimento lordo	2,77744
Rendimento netto	2,59910
Cedola in corso	0,68750
Rateo lordo	0,11775
Rateo netto	0,10303
Vita residua	0,91507
Duration modificata	0,43489
Convessità	0,40484
Cedola successiva	0,68750
Coefficiente di inflazione	1,16365
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	18.972.877.400
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	100,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/01/2010
Prezzo emissione	99,4892
Decorrenza prima cedola regolare	15/01/2010
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/01/2020
Data estinzione	15/01/2020
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	100,2900	USD
Börse Berlin	13/02/2019	99,5200	USD
Euro TLX	13/02/2019	100,7100	USD

Formula di indicizzazione

 Buono del Tesoro Poliennale legato all'Inflazione Americana.
 $Cedole = 0,6875 * VN * IRI/IR0$

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/07/2019	1,375	0,688	Prevista	18.972.877.400	0	181
15/01/2020	1,375	0,688	Prevista	18.972.877.400	18.972.877.400	184

Annotazioni

 Dove:
 VN : Valore nominale dell'obbligazione
 IR : Inflazione di Riferimento
 IR0 : Inflazione di Riferimento iniziale
 $IRi = IRm-3 + (d-1)/D * (IRm-2 - IRm-3)$
 m : mese di riferimento
 d : giorno di riferimento
 D : n. giorni del mese m

 $Rimborso = VN * Max [1; IRf/IR0]$
 IRf : Inflazione di Riferimento alla data di scadenza

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
15/01/2010	15/01/2020	CPI Stati Uniti	1,000	0,000