

GOVT 15/11/10-20 2.625% / US912828PC88

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
99,97 USD	United States of America	15/11/2020	1,313%	2,647%	2,315%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,971
Rendimento lordo	2,64682
Rendimento netto	2,31534
Cedola in corso	1,31250
Rateo lordo	0,66713
Rateo netto	0,58374
Vita residua	1,75068
Duration modificata	1,67039
Convessità	4,45948
Cedola successiva	1,31250
Mercato di riferimento	Frankfurter 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	67.409.882.800
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	100,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/11/2010
Prezzo emissione	99,9039
Decorrenza prima cedola regolare	15/11/2010
Tasso annuale	2,6250
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/11/2020
Data estinzione	15/11/2020
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	99,9710	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,1100	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	100,0750	USD
Börse Berlin	13/02/2019	100,0900	USD
ExtraMOT	13/02/2019	100,1660	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,1100	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/05/2019	2,625	1,313	Certa	67.409.882.800	0	181
15/11/2019	2,625	1,313	Certa	67.409.882.800	0	184
15/05/2020	2,625	1,313	Certa	67.409.882.800	0	182
15/11/2020	2,625	1,313	Certa	67.409.882.800	67.409.882.800	184