

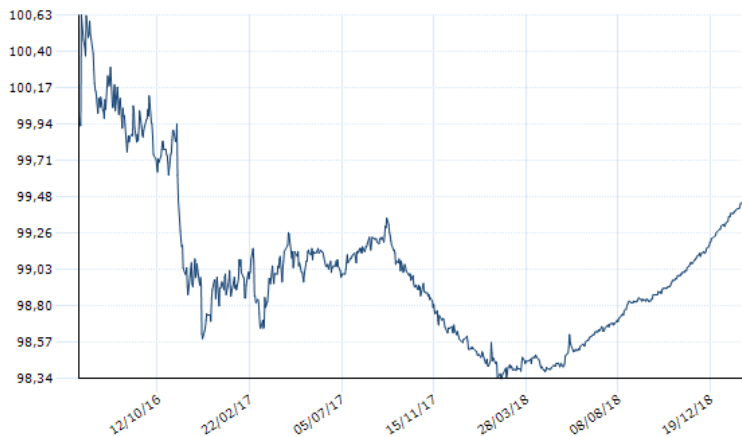
US TREASURY NOTE 0.875% 06/19 / US912828R853
Grado di rischio calcolato

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
99,49 USD	United States of America	15/06/2019	0,438%	2,353%	2,240%


Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	99,49
Rendimento lordo	2,35256
Rendimento netto	2,23996
Cedola in corso	0,43750
Rateo lordo	0,14663
Rateo netto	0,12831
Vita residua	0,33151
Duration modificata	0,32930
Convessità	0,43015
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Börse Berlin

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	24.000.056.400
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	100,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/06/2016
Prezzo emissione	99,8377
Decorrenza prima cedola regolare	15/06/2016
Tasso annuale	0,8750
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/06/2019
Data estinzione	15/06/2019
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	99,3850	USD
Börse Düsseldorf	12/02/2019	99,4900	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	99,4850	USD
Börse Berlin	12/02/2019	99,4900	USD
ExtraMOT	13/02/2019	99,4690	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	99,5000	USD
Euro TLX	13/02/2019	99,7100	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/06/2019	0,875	0,438	Certa	24.000.056.400	24.000.056.400	182