

US TREASURY NOTE 1.125% 06/21 / US912828S273

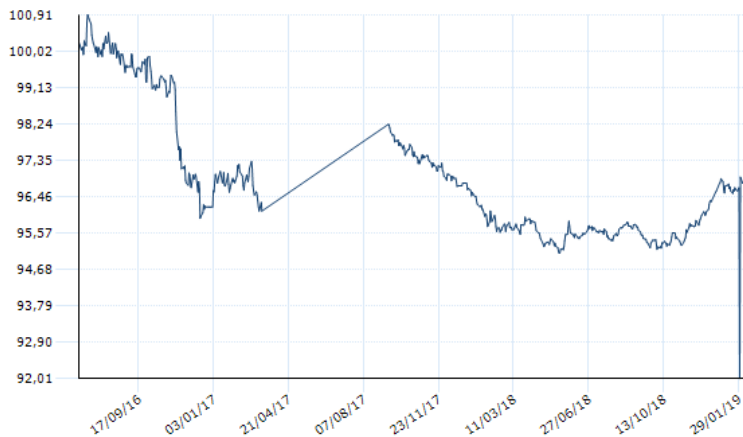
Grado di rischio calcolato

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
96,92 USD	United States of America	30/06/2021	0,563%	2,483%	2,327%



Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	96,92
Rendimento lordo	2,48310
Rendimento netto	2,32744
Cedola in corso	0,56250
Rateo lordo	0,13985
Rateo netto	0,12237
Vita residua	2,37534
Duration modificata	2,29014
Convessità	7,51928
Cedola successiva	0,56250
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	38.959.981.900
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	100,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	30/06/2016
Prezzo emissione	99,5502
Decorrenza prima cedola regolare	30/06/2016
Tasso annuale	1,1250
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	30/06/2021
Data estinzione	30/06/2021
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	96,8700	USD
Börse Düsseldorf	12/02/2019	96,9100	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	96,8910	USD
Börse Berlin	12/02/2019	96,9200	USD
ExtraMOT	13/02/2019	96,7900	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	96,9100	USD
Euro TLX	13/02/2019	96,9600	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
30/06/2019	1,125	0,563	Certa	38.959.981.900	0	181
31/12/2019	1,125	0,563	Certa	38.959.981.900	0	184
30/06/2020	1,125	0,563	Certa	38.959.981.900	0	182
31/12/2020	1,125	0,563	Certa	38.959.981.900	0	184
30/06/2021	1,125	0,563	Certa	38.959.981.900	38.959.981.900	181