

## US TREASURY NOTE 1.125% 07/21 / US912828S760

## 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
96,74 USD	United States of America	31/07/2021	0,563%	2,510%	2,359%



## Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	96,74
Rendimento lordo	2,50987
Rendimento netto	2,35864
Cedola in corso	0,56250
Rateo lordo	0,04351
Rateo netto	0,03807
Vita residua	2,46027
Duration modificata	2,37761
Convessità	8,01261
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	36.374.437.900
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	100,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	31/07/2016
Prezzo emissione	99,7338
Decorrenza prima cedola regolare	31/07/2016
Tasso annuale	1,1250
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

## Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	31/07/2021
Data estinzione	31/07/2021
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	96,6350	USD
Börse Düsseldorf	12/02/2019	96,7200	USD
Bayerische Börse	12/02/2019	96,7310	USD
Börse Berlin	12/02/2019	96,7400	USD
ExtraMOT	13/02/2019	96,7800	USD
Börse Stuttgart	12/02/2019	96,7400	USD
Euro TLX	13/02/2019	96,8100	USD

## Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
31/07/2019	1,125	0,563	Certa	36.374.437.900	0	181
31/01/2020	1,125	0,563	Certa	36.374.437.900	0	184
31/07/2020	1,125	0,563	Certa	36.374.437.900	0	182
31/01/2021	1,125	0,563	Certa	36.374.437.900	0	184
31/07/2021	1,125	0,563	Certa	36.374.437.900	36.374.437.900	181