

US TIPS 15/01/13-23 0.125% / US912828UH11

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
97,66 USD	United States of America	15/01/2023	0,063%	2,928%	2,912%



Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	97,660156
Rendimento lordo	2,92818
Rendimento netto	2,91197
Cedola in corso	0,06250
Rateo lordo	0,01036
Rateo netto	0,00906
Vita residua	3,92055
Duration modificata	1,74737
Convessità	4,17620
Cedola successiva	0,06250
Coefficiente di inflazione	1,09030

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	40.998.485.600
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	100,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/01/2013
Prezzo emissione	107,5059
Decorrenza prima cedola regolare	15/01/2013
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/01/2023
Data estinzione	15/01/2023
Base rateo capitale	Composta
Indicizzazione sul capitale	Si
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 12,5%

Formula di indicizzazione

 Buono del Tesoro Poliennale legato all'Inflazione Americana.
 $Cedole = 0.0625 * VN * IRi/IR0$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/07/2019	0,125	0,063	Prevista	40.998.485.600	0	181
15/01/2020	0,125	0,063	Prevista	40.998.485.600	0	184
15/07/2020	0,125	0,063	Prevista	40.998.485.600	0	182
15/01/2021	0,125	0,063	Prevista	40.998.485.600	0	184
15/07/2021	0,125	0,063	Prevista	40.998.485.600	0	181
15/01/2022	0,125	0,063	Prevista	40.998.485.600	0	184
15/07/2022	0,125	0,063	Prevista	40.998.485.600	0	181
15/01/2023	0,125	0,063	Prevista	40.998.485.600	40.998.485.600	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
15/01/2013	15/01/2023	CPI Stati Uniti	1,000	0,000