

US TIPS 15/01/17-27 0.375% / US912828V491

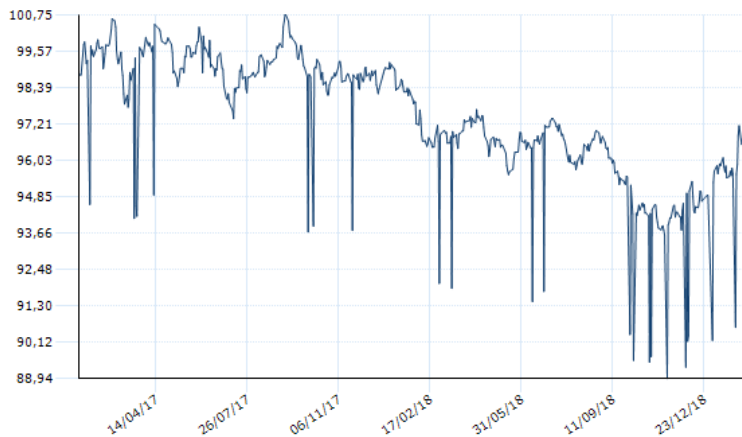
Grado di rischio calcolato

| | | | | | | | | |
|-------------------|---|---|---|---|---|---|---|-----------------|
| 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 |
| 96,61 USD | United States of America | 15/01/2027 | 0,188% | 3,017% | 2,967% |



Analisi

| | |
|----------------------------|------------------|
| Data ultima quotazione | 12/02/2019 |
| Data valutazione | 12/02/2019 |
| Data valuta | 14/02/2019 |
| Prezzo | 96,61 |
| Rendimento lordo | 3,01696 |
| Rendimento netto | 2,96744 |
| Cedola in corso | 0,18750 |
| Rateo lordo | 0,03108 |
| Rateo netto | 0,02719 |
| Vita residua | 7,92329 |
| Duration modificata | 3,19783 |
| Convessità | 13,78246 |
| Cedola successiva | 0,18750 |
| Coefficiente di inflazione | 1,04183 |
| Mercato di riferimento | Börse Düsseldorf |

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 | 13.824.492.200 |
| Nominale obbligazione | 100,00 |
| Taglio minimo | 100,00 |
| Corso | Secco |
| Sottoscrizione | Regular |
| Data emissione | 15/01/2017 |
| Prezzo emissione | 99,9541 |
| Decorrenza prima cedola regolare | 15/01/2017 |
| Frequenza cedola | 2 |
| Base rateo cedola | ACT/ACT |
| Subordinato | NO |

Rimborso

| | |
|-----------------------------|-----------------|
| Tipo ammortamento | Unica Soluzione |
| Data 1° rimborso | 15/01/2027 |
| Data estinzione | 15/01/2027 |
| Base rateo capitale | Composta |
| Indicizzazione sul capitale | Si |
| 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 | 96,5700 USD |
| Börse Düsseldorf | 12/02/2019 | 96,6100 USD |
| Börse Berlin | 12/02/2019 | 96,6300 USD |

Formula di indicizzazione

 Buono del Tesoro Poliennale legato all'Inflazione Americana.
 $Cedole = 0,1875 * VN * IRI/IR0$

Flusso cedolare

| Data flusso | Tasso annuo % | Val. cedola | Tipo cedola | Val. residuo | Val. ammortato | Giorni |
|-------------|---------------|-------------|-------------|----------------|----------------|--------|
| 15/07/2019 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 181 |
| 15/01/2020 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 184 |
| 15/07/2020 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 182 |
| 15/01/2021 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 184 |
| 15/07/2021 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 181 |
| 15/01/2022 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 184 |
| 15/07/2022 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 181 |
| 15/01/2023 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 184 |
| 15/07/2023 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 181 |
| 15/01/2024 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 184 |
| 15/07/2024 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 182 |
| 15/01/2025 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 184 |
| 15/07/2025 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 181 |
| 15/01/2026 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 184 |
| 15/07/2026 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 0 | 181 |
| 15/01/2027 | 0,375 | 0,188 | Prevista | 13.824.492.200 | 13.824.492.200 | 184 |

Annotazioni

 Dove:
 VN : Valore nominale dell'obbligazione
 IR : Inflazione di Riferimento
 IR0 : Inflazione di Riferimento iniziale (241.55919)
 $IRi = IRm-3 + (d-1)/D * (IRm-2 - IRm-3)$
 m : mese di riferimento
 d : giorno di riferimento
 D : n. giorni del mese m
 Rimborso = $VN * \text{Max} [1; IRf/IR0]$
 IRf : Inflazione di Riferimento alla data di scadenza

Indicizzazione cedole

| Da | A | Descrizione indice | Peso | Spread |
|------------|------------|--------------------|-------|--------|
| 15/01/2017 | 15/01/2027 | CPI Stati Uniti | 1,000 | 0,000 |