

GOVT 15/11/13-23 2.75% / US912828WE61

Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Grado Liquidità

Molto liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
100,97 USD	United States of America	15/11/2023	1,375%	2,545%	2,199%



Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,97
Rendimento lordo	2,54465
Rendimento netto	2,19926
Cedola in corso	1,37500
Rateo lordo	0,69890
Rateo netto	0,61153
Vita residua	4,75068
Duration modificata	4,34731
Convessità	23,94780
Cedola successiva	1,37500
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

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	65.996.109.100
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	100,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/11/2013
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	15/11/2013
Tasso annuale	2,7500
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/11/2023
Data estinzione	15/11/2023
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	13/02/2019	100,9700	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	101,0100	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	100,9460	USD
Börse Berlin	13/02/2019	101,0700	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	101,0200	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/05/2019	2,750	1,375	Certa	65.996.109.100	0	181
15/11/2019	2,750	1,375	Certa	65.996.109.100	0	184
15/05/2020	2,750	1,375	Certa	65.996.109.100	0	182
15/11/2020	2,750	1,375	Certa	65.996.109.100	0	184
15/05/2021	2,750	1,375	Certa	65.996.109.100	0	181
15/11/2021	2,750	1,375	Certa	65.996.109.100	0	184
15/05/2022	2,750	1,375	Certa	65.996.109.100	0	181
15/11/2022	2,750	1,375	Certa	65.996.109.100	0	184
15/05/2023	2,750	1,375	Certa	65.996.109.100	0	181
15/11/2023	2,750	1,375	Certa	65.996.109.100	65.996.109.100	184