

US TREASURY NOTE 1.50% 05/20 / US912828X968

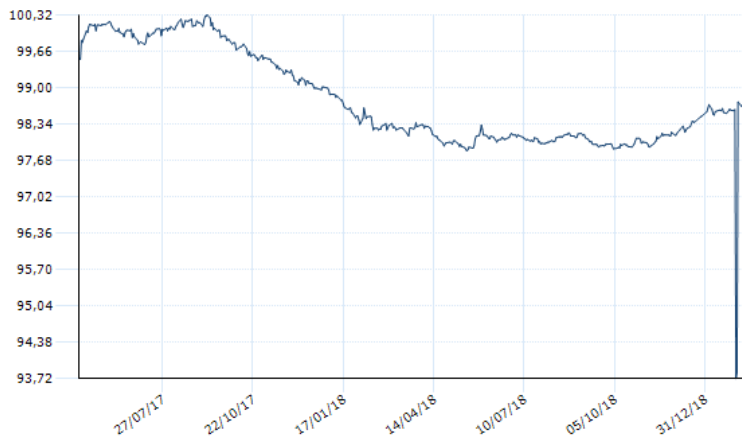
Grado di rischio calcolato

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
98,72 USD	United States of America	15/05/2020	0,750%	2,562%	2,362%



Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	98,72
Rendimento lordo	2,56184
Rendimento netto	2,36213
Cedola in corso	0,75000
Rateo lordo	0,37707
Rateo netto	0,32994
Vita residua	1,24932
Duration modificata	1,20715
Convessità	2,64302
Cedola successiva	0,75000
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	31.929.051.900
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	100,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	15/05/2017
Prezzo emissione	99,7898
Decorrenza prima cedola regolare	15/05/2017
Tasso annuale	1,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/05/2020
Data estinzione	15/05/2020
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	98,7400 USD
Börse Düsseldorf	12/02/2019	98,7000 USD
Börse Berlin	12/02/2019	98,7200 USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/05/2019	1,500	0,750	Certa	31.929.051.900	0	181
15/11/2019	1,500	0,750	Certa	31.929.051.900	0	184
15/05/2020	1,500	0,750	Certa	31.929.051.900	31.929.051.900	182