

GOLDMAN SACHS G Indexed 03/20 / XS1026366861
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
99,16 EUR	Goldman Sachs Group	31/03/2020	0,000%	0,754%	0,754%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,16
Rendimento lordo	0,75379
Rendimento netto	0,75379
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	1,12329
Duration modificata	0,11488
Convessità	0,12808
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Goldman Sachs Group
Tipo obbligazione	Index Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	213.413.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco + Tel-quel
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	31/03/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	31/03/2014
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	31/03/2020
Data estinzione	31/03/2020
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	100,0900	EUR
Euro TLX	13/02/2019	99,1600	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
01/04/2019	0,000	0,000	Prevista	213.413.000	0	363
31/03/2020	0,000	0,000	Prevista	213.413.000	213.413.000	365

Annotazioni

Primo anno tasso fisso annuo del 2.50%.
 Poi annualmente verrà corrisposta una cedola pari a:
 Cedola = X% se a > 110% b (Minimum Performance)
 0.00% se Altrimenti
 Dove:
 a, b : FTSE MIB
 EUROSTOXX 50
 a : Valore di chiusura degli Indici rilevati annualmente dal 22/03/2016 al 22/03/2020 (se non festivi)
 b : Valori di chiusura del Paniere alla data di emissione
 X : 3.00% (2o anno)
 3.25% (3o anno)
 3.75% (4o anno)
 4.50% (5o anno)
 6.00% (6o anno)