

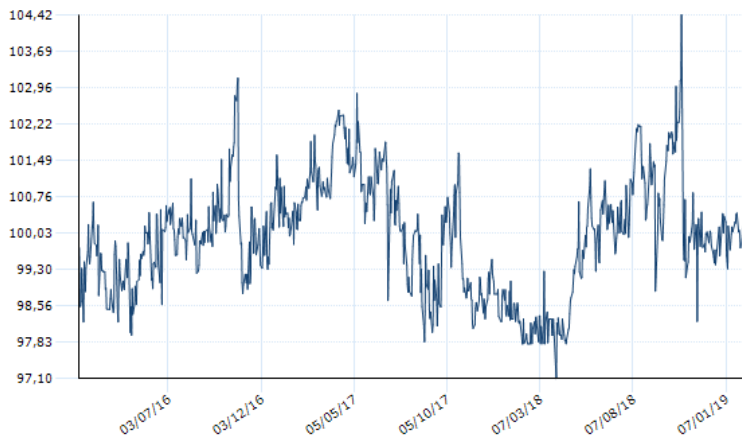
GOLDMAN SACHS G EUR/USD 10/21 / XS1112822181
Grado di rischio calcolato

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
100,78 EUR	Goldman Sachs Group	29/10/2021	3,750%	3,440%	2,472%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,78
Rendimento lordo	3,44007
Rendimento netto	2,47215
Cedola in corso	3,75000
Rateo lordo	1,10417
Rateo netto	0,81708
Vita residua	2,70411
Duration modificata	0,72152
Convessità	1,24212
Cedola successiva	3,75000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Goldman Sachs Group
Tipo obbligazione	Currency Linked
Tipo tasso	Tasso Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	32.752.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Prezzo Tel-quel
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	31/10/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	29/10/2015
Data Prorata	31/10/2014
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	29/10/2021
Data estinzione	29/10/2021
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	100,7200	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,7800	EUR

Formula di indicizzazione
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
29/10/2019	0,000	3,750	Prevista	32.752.000	0	365
29/10/2020	0,000	3,750	Prevista	32.752.000	0	366
29/10/2021	0,000	3,750	Prevista	32.752.000	32.752.000	365

Annotazioni

Annualmente verrà corrisposta una cedola così calcolata:
 Cedola= VN* [3.75% se a <= 95% b
 0.00 se Altrimenti
 Dove:
 a, b: Tasso di cambio Euro/Dollaro
 a : Valore del Cambio EUR/USD 2 giorni antecedenti il pagamento della cedola
 B : Valore del Cambio EUR/USD alla data di emissione