

GOLDMAN SACHS G 2.70% 11/21 /XS1113247784
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
97,51 USD	Goldman Sachs Group	12/11/2021	1,350%	3,694%	2,970%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,51
Rendimento lordo	3,69432
Rendimento netto	2,97041
Cedola in corso	1,35000
Rateo lordo	0,69750
Rateo netto	0,51615
Vita residua	2,74247
Duration modificata	2,54833
Convessità	9,11429
Cedola successiva	1,35000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Goldman Sachs Group
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	19.300.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	12/11/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	12/11/2014
Tasso annuale	2,7000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	12/11/2021
Data estinzione	12/11/2021
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	97,4850	USD
Euro TLX	13/02/2019	97,5100	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
12/05/2019	2,700	1,350	Certa	19.300.000	0	181
12/11/2019	2,700	1,350	Certa	19.300.000	0	184
12/05/2020	2,700	1,350	Certa	19.300.000	0	182
12/11/2020	2,700	1,350	Certa	19.300.000	0	184
12/05/2021	2,700	1,350	Certa	19.300.000	0	181
12/11/2021	2,700	1,350	Certa	19.300.000	19.300.000	184