

GOLDMAN SACHS G 2.425% 12/21 / XS1130058743
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
96,65 USD	Goldman Sachs Group	02/12/2021	1,213%	3,730%	3,076%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	96,65
Rendimento lordo	3,72979
Rendimento netto	3,07579
Cedola in corso	1,21250
Rateo lordo	0,49174
Rateo netto	0,36388
Vita residua	2,79726
Duration modificata	2,60946
Convessità	9,47275
Cedola successiva	1,21250
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	210.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	02/12/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	02/12/2014
Tasso annuale	2,4250
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	02/12/2021
Data estinzione	02/12/2021
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	96,8700	USD
Euro TLX	13/02/2019	96,6500	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
02/06/2019	2,425	1,213	Certa	210.000.000	0	182
02/12/2019	2,425	1,213	Certa	210.000.000	0	183
02/06/2020	2,425	1,213	Certa	210.000.000	0	183
02/12/2020	2,425	1,213	Certa	210.000.000	0	183
02/06/2021	2,425	1,213	Certa	210.000.000	0	182
02/12/2021	2,425	1,213	Certa	210.000.000	210.000.000	183