

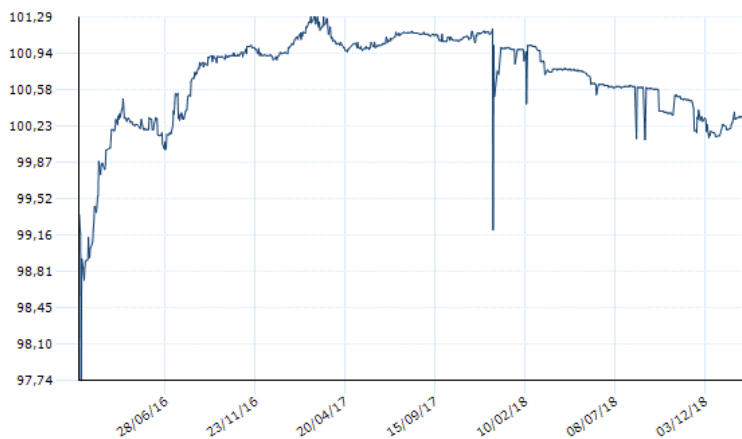
**GOLDMAN SACHS G Euribor3m 10/19 / XS1130101931**
**Grado di rischio calcolato**

|                   |   |   |   |   |   |   |   |                 |
|-------------------|---|---|---|---|---|---|---|-----------------|
| 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 |
| 100,31 EUR | Goldman Sachs Group | 29/10/2019 | 0,111%          | 0,008%           | -0,115%          |


**Analisi**

|                        |                   |
|------------------------|-------------------|
| Data ultima quotazione | 13/02/2019        |
| Data valutazione       | 13/02/2019        |
| Data valuta            | 15/02/2019        |
| Prezzo                 | 100,31            |
| Rendimento lordo       | 0,00818           |
| Rendimento netto       | -0,11468          |
| Cedola in corso        | 0,11080           |
| Rateo lordo            | 0,02092           |
| Rateo netto            | 0,01548           |
| Vita residua           | 0,70137           |
| Duration modificata    | 0,20625           |
| Convessità             | 0,24880           |
| Cedola successiva      | 0,11300           |
| Mercato di riferimento | Frankfurter Börse |

**Dati anagrafici principali**

|                   |                     |
|-------------------|---------------------|
| Ente emittente    | Goldman Sachs Group |
| Tipo obbligazione | Plain Vanilla       |
| Tipo tasso        | Tasso Variabile     |
| Divisa            | EUR                 |
| Convertibilità    | Nessuno             |

**Caratteristiche principali**

|                                  |               |
|----------------------------------|---------------|
| Nominale circolante              | 1.550.000.000 |
| Nominale obbligazione            | 1.000,00      |
| Taglio minimo                    | 1.000,00      |
| Corso                            | Secco         |
| Sottoscrizione                   | Regular       |
| Data emissione                   | 29/10/2014    |
| Prezzo emissione                 | 99,8510       |
| Decorrenza prima cedola regolare | 29/10/2014    |
| Frequenza cedola                 | 4             |
| Base rateo cedola                | ACT/360       |
| Subordinato                      | NO            |

**Rimborso**

|                             |                 |
|-----------------------------|-----------------|
| Tipo ammortamento           | Unica Soluzione |
| Data 1° rimborso            | 29/10/2019      |
| Data estinzione             | 29/10/2019      |
| 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 |
|----------------------|------------|----------|--------|
| Frankfurter Börse    | 13/02/2019 | 100,3100 | EUR    |
| Börse Düsseldorf     | 13/02/2019 | 100,3500 | EUR    |
| Bayerische Börse     | 13/02/2019 | 100,3300 | EUR    |
| Börse Berlin         | 13/02/2019 | 100,3300 | EUR    |
| ExtraMOT             | 13/02/2019 | 100,4870 | EUR    |
| Bourse de Luxembourg | 13/02/2019 | 100,3510 | EUR    |
| Börse Stuttgart      | 13/02/2019 | 100,3300 | EUR    |

**Formula di indicizzazione**
 $TV = (\text{Euribor } 3m + 0,75) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2\text{gg.)}$ 
**Flusso cedolare**

| Data flusso | Tasso annuo % | Val. cedola | Tipo cedola | Val. residuo  | Val. ammortato | Giorni |
|-------------|---------------|-------------|-------------|---------------|----------------|--------|
| 29/04/2019  | 0,000         | 0,111       | Certa       | 1.550.000.000 | 0              | 90     |
| 29/07/2019  | 0,000         | 0,113       | Prevista    | 1.550.000.000 | 0              | 91     |
| 29/10/2019  | 0,000         | 0,113       | Prevista    | 1.550.000.000 | 1.550.000.000  | 92     |

**Indicizzazione cedole**

| Da         | A          | Descrizione indice | Peso  | Spread |
|------------|------------|--------------------|-------|--------|
| 29/10/2014 | 29/10/2019 | EURIBOR3M          | 1,000 | 0,750  |