

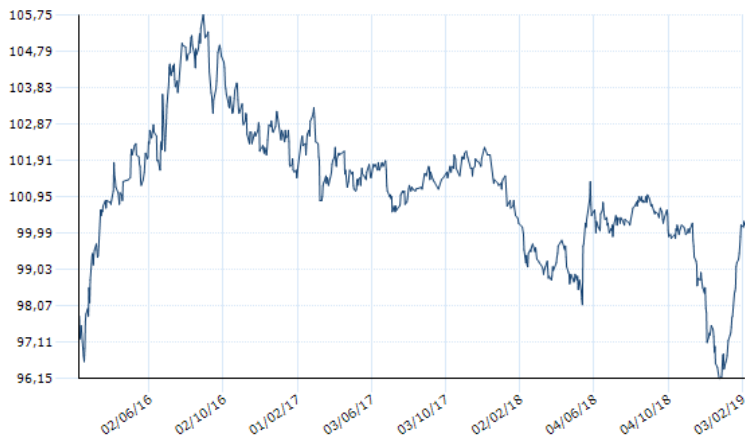
GOLDMAN SACHS INT 1.75% 05/24 / XS1166507548
Grado di rischio calcolato

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
100,25 EUR	Goldman Sachs International	29/05/2024	1,750%	1,700%	1,246%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,25
Rendimento lordo	1,70003
Rendimento netto	1,24586
Cedola in corso	1,75000
Rateo lordo	1,24444
Rateo netto	0,92089
Vita residua	5,28767
Duration modificata	4,95163
Convessità	30,22596
Cedola successiva	1,75000
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Goldman Sachs International
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	100.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	29/05/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	29/05/2015
Tasso annuale	1,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30E/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	29/05/2024
Data estinzione	29/05/2024
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	97,8250	EUR
EuroMOT	13/02/2019	100,8100	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	100,2500	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
29/05/2019	1,750	1,750	Certa	100.000.000	0	365
29/05/2020	1,750	1,750	Certa	100.000.000	0	366
29/05/2021	1,750	1,750	Certa	100.000.000	0	365
29/05/2022	1,750	1,750	Certa	100.000.000	0	365
29/05/2023	1,750	1,750	Certa	100.000.000	0	365
29/05/2024	1,750	1,750	Certa	100.000.000	100.000.000	366