

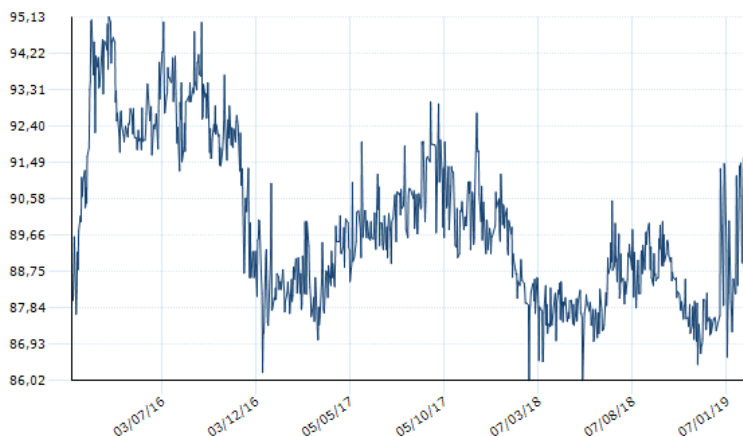
GOLDMAN SACHS G Indexed 05/22 / XS1210360456
Grado di rischio calcolato

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
88,9 USD	Goldman Sachs Group	19/05/2022	0,000%	3,678%	3,678%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	88,9
Rendimento lordo	3,67789
Rendimento netto	3,67789
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	3,25753
Duration modificata	0,03029
Convessità	0,03120
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Goldman Sachs Group
Tipo obbligazione	Index Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	44.324.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco + Tel-quel
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	19/05/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	19/05/2015
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	19/05/2022
Data estinzione	19/05/2022
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	01/02/2019	91,7150	USD
Euro TLX	13/02/2019	88,9000	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
19/05/2019	0,000	0,000	Prevista	44.324.000	0	365
19/05/2020	0,000	0,000	Prevista	44.324.000	0	366
19/05/2021	0,000	0,000	Prevista	44.324.000	0	365
19/05/2022	0,000	0,000	Prevista	44.324.000	44.324.000	365

Annotazioni

Primi tre anni tasso fisso annuo del 2.20%.
 Poi annualmente verra' corrisposta una cedola pari a:
 Cedola= VN * 5.00% se a > 105% * b
 0.00% se Altrimenti
 Dove:
 a,b : Indice S&P GSCI® Crude Oil Index ER
 a : Valore di chiusura dell'Indice rilevato annualmente il 12 maggio dal 2019 al 2022 (se non festivi)
 b : Valore di chiusura dell'Indice al 19 maggio 2015