

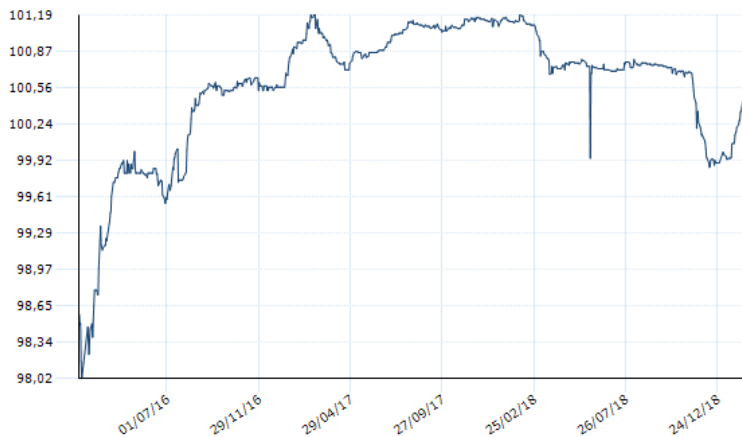
GOLDMAN SACHS G Euribor3m 05/20 / XS1240146891
Grado di rischio calcolato

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
100,46 EUR	Goldman Sachs Group	29/05/2020	0,098%	0,046%	-0,059%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	100,46
Rendimento lordo	0,04581
Rendimento netto	-0,05891
Cedola in corso	0,09810
Rateo lordo	0,08411
Rateo netto	0,06224
Vita residua	1,28493
Duration modificata	0,04864
Convessità	0,05100
Cedola successiva	0,10100
Mercato di riferimento	Börse Berlin

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.500.000.000
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
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	29/05/2020
Data estinzione	29/05/2020
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	100,5000	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	100,4600	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	100,5000	EUR
Börse Berlin	13/02/2019	100,4600	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	100,5350	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	100,5360	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	100,5000	EUR
Euro TLX	13/02/2019	100,9800	EUR

Formula di indicizzazione

$$TV = (\text{Euribor } 3m + 0.70) * \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2gg.)$$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
28/02/2019	0,000	0,098	Certa	1.500.000.000	0	91
29/05/2019	0,000	0,101	Prevista	1.500.000.000	0	90
29/08/2019	0,000	0,101	Prevista	1.500.000.000	0	92
29/11/2019	0,000	0,101	Prevista	1.500.000.000	0	92
28/02/2020	0,000	0,101	Prevista	1.500.000.000	0	91
29/05/2020	0,000	0,101	Prevista	1.500.000.000	1.500.000.000	91

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
29/05/2015	29/05/2020	EURIBOR3M	1,000	0,700