

**GOLDMAN SACHS INT TF+TV 11/27 / XS1241085353**
**Grado di rischio calcolato**

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

**Grado Liquidità**

Liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
93,57 EUR	Goldman Sachs International	26/11/2027	0,134%	0,908%	0,869%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	93,57
Rendimento lordo	0,90796
Rendimento netto	0,86936
Cedola in corso	0,13400
Rateo lordo	0,02941
Rateo netto	0,02176
Vita residua	8,78356
Duration modificata	0,69342
Convessità	1,17424
Cedola successiva	0,14400
Mercato di riferimento	EuroMOT

**Dati anagrafici principali**

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

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	50.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	26/11/2015
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	26/11/2015
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	26/11/2027
Data estinzione	26/11/2027
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
EuroMOT	13/02/2019	93,5700 EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	94,6300 EUR

**Formula di indicizzazione**

Primi 2 anni tasso fisso annuo del 3.00%.  
 Poi cedole variabili annuali così calcolate:  
 $TV = (\text{Euribor } 3m + 0.45) \text{ (puntuale } 2\text{gg)}$

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
26/11/2019	0,000	0,134	Certa	50.000.000	0	365
26/11/2020	0,000	0,144	Prevista	50.000.000	0	366
26/11/2021	0,000	0,144	Prevista	50.000.000	0	365
26/11/2022	0,000	0,144	Prevista	50.000.000	0	365
26/11/2023	0,000	0,144	Prevista	50.000.000	0	365
26/11/2024	0,000	0,144	Prevista	50.000.000	0	366
26/11/2025	0,000	0,144	Prevista	50.000.000	0	365
26/11/2026	0,000	0,144	Prevista	50.000.000	0	365
26/11/2027	0,000	0,144	Prevista	50.000.000	50.000.000	365

**Indicizzazione cedole**

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
26/11/2017	26/11/2027	EURIBOR3M	1,000	0,450