

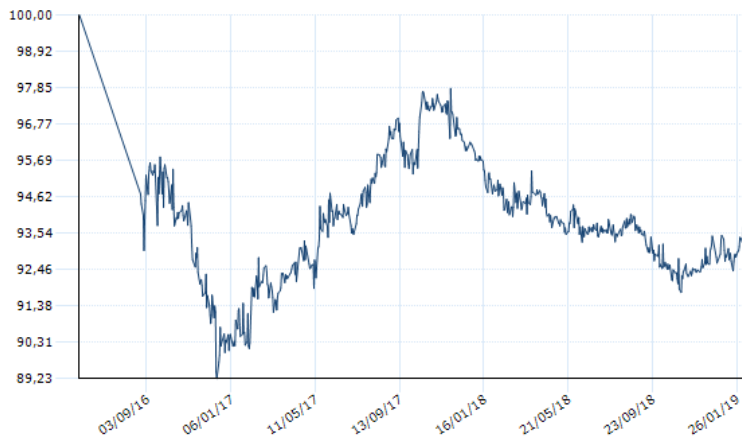
GOLDMAN SACHS G Step-up 11/22 / XS1308289146
Grado di rischio calcolato

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
94,61 USD	Goldman Sachs Group	26/11/2022	2,000%	3,753%	3,162%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	94,61
Rendimento lordo	3,75328
Rendimento netto	3,16157
Cedola in corso	2,00000
Rateo lordo	0,43889
Rateo netto	0,32478
Vita residua	3,78082
Duration modificata	3,52981
Convessità	16,11618
Cedola successiva	2,10000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Goldman Sachs Group
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	369.612.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	26/05/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	26/11/2017
Data Prorata	26/05/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	26/11/2022
Data estinzione	26/11/2022
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	12/02/2019	95,0000	USD
Euro TLX	13/02/2019	94,6100	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
26/11/2019	2,000	2,000	Certa	369.612.000	0	365
26/11/2020	2,100	2,100	Certa	369.612.000	0	366
26/11/2021	2,200	2,200	Certa	369.612.000	0	365
26/11/2022	2,500	2,500	Certa	369.612.000	369.612.000	365