

GOLDMAN SACHS G EUROSTOXX 04/24 / XS1308290664
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
98,81 EUR	Goldman Sachs Group	04/04/2024	2,500%	3,216%	2,433%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,81
Rendimento lordo	3,21645
Rendimento netto	2,43312
Cedola in corso	2,50000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	5,13699
Duration modificata	0,06267
Convessità	0,06659
Cedola successiva	2,50000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	98,3300	EUR
Euro TLX	13/02/2019	98,8100	EUR

Caratteristiche principali

Nominale circolante	200.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco + Tel-quel
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	04/04/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	04/04/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	04/04/2024
Data estinzione	04/04/2024
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
04/04/2019	0,000	2,500	Prevista	200.000.000	0	365
04/04/2020	0,000	2,500	Prevista	200.000.000	0	366
04/04/2021	0,000	2,500	Prevista	200.000.000	0	365
04/04/2022	0,000	2,500	Prevista	200.000.000	0	365
04/04/2023	0,000	2,500	Prevista	200.000.000	0	365
04/04/2024	0,000	2,500	Prevista	200.000.000	200.000.000	366

Annotazioni

Primo anno tasso fisso annuo del 2.00%.
 Poi annualmente verra' corrisposta una cedola pari a:
 Cedola= 2.00% se a > 100% b
 0.00% se Altrimenti
 Dove:
 a,b : EUROSTOXX 50
 a : Valore di chiusura dell'Indice rilevato annualmente dal 26/03/2016 al 26/03/2024 (se non festivi)
 b : Valore di chiusura dell'Indice alla data di emissione