

GOLDMAN SACHS G USD TF+TV 04/22 / XS1308291472
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
97,97 USD	Goldman Sachs Group	08/04/2022	0,826%	3,989%	3,114%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,97
Rendimento lordo	3,98881
Rendimento netto	3,11386
Cedola in corso	0,82600
Rateo lordo	0,33957
Rateo netto	0,25128
Vita residua	3,14521
Duration modificata	0,11826
Convessità	0,13225
Cedola successiva	0,80900
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	500.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	08/04/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	08/04/2016
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30/360
Cedola massima %	1,00
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	08/04/2022
Data estinzione	08/04/2022
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	97,9400 USD
Euro TLX	13/02/2019	97,9700 USD

Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso trimestrale dello 0.7625%.
Poi cedole variabili trimestrali così calcolate:
TV= (USDLibor 3m + 0.50)/4 (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
08/04/2019	0,000	0,826	Certa	500.000.000	0	90
08/07/2019	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	0	91
08/10/2019	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	0	92
08/01/2020	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	0	92
08/04/2020	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	0	91
08/07/2020	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	0	91
08/10/2020	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	0	92
08/01/2021	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	0	92
08/04/2021	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	0	90
08/07/2021	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	0	91
08/10/2021	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	0	92
08/01/2022	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	0	92
08/04/2022	0,000	0,809	Prevista	500.000.000	500.000.000	90

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
04/08/2018	04/08/2022	USDLIBOR3M	1,000	0,500