

**GOLDMAN SACHS INT TF+TV 03/28 / XS1317187646**
**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
89,09 EUR	Goldman Sachs International	10/03/2028	0,173%	1,488%	1,435%


**Analisi**

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	89,09
Rendimento lordo	1,48843
Rendimento netto	1,43466
Cedola in corso	0,17300
Rateo lordo	0,16099
Rateo netto	0,11913
Vita residua	9,07123
Duration modificata	0,28457
Convessità	0,36555
Cedola successiva	0,19400
Mercato di riferimento	EuroMOT

**Dati anagrafici principali**

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

**Caratteristiche principali**

Nominale circolante	75.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	10/03/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	10/03/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Cedola massima %	3,50
Subordinato	NO

**Rimborso**

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	10/03/2028
Data estinzione	10/03/2028
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	89,0900 EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	94,2100 EUR

**Formula di indicizzazione**

Primi 2 anni tasso fisso annuo del 3.50%.  
Poi cedole variabili annuali così calcolate:  
TV= (Euribor 3m + 0.50) (puntuale 2gg)

**Flusso cedolare**

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
10/03/2019	0,173	0,173	Certa	75.000.000	0	365
10/03/2020	0,000	0,194	Prevista	75.000.000	0	366
10/03/2021	0,000	0,194	Prevista	75.000.000	0	365
10/03/2022	0,000	0,194	Prevista	75.000.000	0	365
10/03/2023	0,000	0,194	Prevista	75.000.000	0	365
10/03/2024	0,000	0,194	Prevista	75.000.000	0	366
10/03/2025	0,000	0,194	Prevista	75.000.000	0	365
10/03/2026	0,000	0,194	Prevista	75.000.000	0	365
10/03/2027	0,000	0,194	Prevista	75.000.000	0	365
10/03/2028	0,000	0,194	Prevista	75.000.000	75.000.000	366

**Indicizzazione cedole**

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
10/03/2018	10/03/2028	EURIBOR3M	1,000	0,500