

GOLDMAN SACHS G Euribor3m 07/21 / XS1458408306
Grado di rischio calcolato

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

Grado Liquidità

Molto liquido

12/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
100,66 EUR	Goldman Sachs Group	27/07/2021	0,175%	0,438%	0,254%


Analisi

Data ultima quotazione	12/02/2019
Data valutazione	12/02/2019
Data valuta	14/02/2019
Prezzo	100,66
Rendimento lordo	0,43828
Rendimento netto	0,25424
Cedola in corso	0,17540
Rateo lordo	0,03277
Rateo netto	0,02425
Vita residua	2,44932
Duration modificata	0,24280
Convessità	0,30176
Cedola successiva	0,17700
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	27/07/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	27/07/2016
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	ACT/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	27/07/2021
Data estinzione	27/07/2021
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
Frankfurter Börse	12/02/2019	100,6600	EUR
Börse Düsseldorf	12/02/2019	100,6200	EUR
Bayerische Börse	12/02/2019	100,5100	EUR
Börse Berlin	12/02/2019	100,5300	EUR
ExtraMOT	13/02/2019	101,6200	EUR
Bourse de Luxembourg	12/02/2019	100,6300	EUR
Börse Stuttgart	12/02/2019	100,6600	EUR

Formula di indicizzazione
 $TV = (\text{Euribor } 3m + 1,00) \cdot \text{act}/360 \text{ (puntuale } 2\text{gg.)}$
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
29/04/2019	0,000	0,175	Certa	2.000.000.000	0	91
29/07/2019	0,000	0,177	Prevista	2.000.000.000	0	91
28/10/2019	0,000	0,177	Prevista	2.000.000.000	0	91
27/01/2020	0,000	0,177	Prevista	2.000.000.000	0	91
27/04/2020	0,000	0,177	Prevista	2.000.000.000	0	91
27/07/2020	0,000	0,177	Prevista	2.000.000.000	0	91
27/10/2020	0,000	0,177	Prevista	2.000.000.000	0	92
27/01/2021	0,000	0,177	Prevista	2.000.000.000	0	92
27/04/2021	0,000	0,177	Prevista	2.000.000.000	0	90
27/07/2021	0,000	0,177	Prevista	2.000.000.000	2.000.000.000	91

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
27/07/2016	27/07/2021	EURIBOR3M	1,000	1,000