

GOLDMAN SACHS FIN TF+TV 04/27 / XS1561100600
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
93,72 EUR	Goldman Sachs Finance Corp In...	20/04/2027	3,250%	1,381%	1,228%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	93,72
Rendimento lordo	1,38072
Rendimento netto	1,22841
Cedola in corso	3,25000
Rateo lordo	2,66319
Rateo netto	1,97076
Vita residua	8,18082
Duration modificata	0,08850
Convessità	0,09634
Cedola successiva	0,50000
Mercato di riferimento	EuroMOT

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Goldman Sachs Finance Corp International (Jersey Ltd)
Tipo obbligazione	Interest Rate Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	90.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	20/04/2017
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	20/04/2017
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Cedola minima %	0,50
Cedola massima %	3,25
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	20/04/2027
Data estinzione	20/04/2027
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	93,7200	EUR

Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso annuo del 3,25%.
Poi cedole variabili annuali così calcolate:
TV= (Euribor 3m) (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
20/04/2019	3,250	3,250	Certa	90.000.000	0	365
20/04/2020	0,000	0,500	Prevista	90.000.000	0	366
20/04/2021	0,000	0,500	Prevista	90.000.000	0	365
20/04/2022	0,000	0,500	Prevista	90.000.000	0	365
20/04/2023	0,000	0,500	Prevista	90.000.000	0	365
20/04/2024	0,000	0,500	Prevista	90.000.000	0	366
20/04/2025	0,000	0,500	Prevista	90.000.000	0	365
20/04/2026	0,000	0,500	Prevista	90.000.000	0	365
20/04/2027	0,000	0,500	Prevista	90.000.000	90.000.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
20/04/2019	20/04/2027	EURIBOR3M	1,000	0,000