

C.SUISSE INT. 4.75% 08/19 / XS0444030646

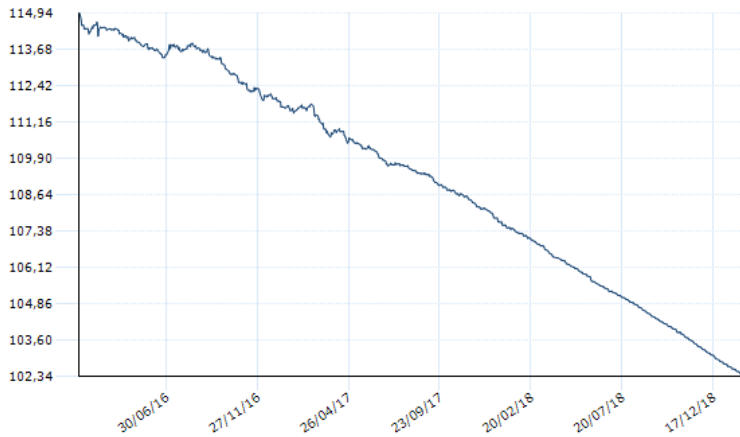
Grado di rischio calcolato

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
102,3 EUR	Credit Suisse International	05/08/2019	4,750%	-0,150%	-1,343%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	102,3
Rendimento lordo	-0,14994
Rendimento netto	-1,34314
Cedola in corso	4,75000
Rateo lordo	2,52466
Rateo netto	1,86825
Vita residua	0,46849
Duration modificata	0,46816
Convessità	0,68749
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Credit Suisse International
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.000.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	50.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	05/08/2009
Prezzo emissione	99,1760
Decorrenza prima cedola regolare	05/08/2009
Tasso annuale	4,7500
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	05/08/2019
Data estinzione	05/08/2019
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
SIX Swiss Exchange	13/02/2019	113,0200	EUR
Frankfurter Börse	13/02/2019	102,3000	EUR
Börse Düsseldorf	13/02/2019	102,3300	EUR
Bayerische Börse	13/02/2019	102,3200	EUR
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	102,3300	EUR
Börse Stuttgart	13/02/2019	102,3200	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
05/08/2019	4,750	4,750	Certa	2.000.000.000	2.000.000.000	365