

C.SUISSE LONDON DJEUROSTO 09/21 / XS1040303197
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
99,46 EUR	Credit Suisse (London Branch)	24/09/2021	0,000%	0,208%	0,208%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,46
Rendimento lordo	0,20781
Rendimento netto	0,20781
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	2,60822
Duration modificata	0,60073
Convessità	0,96161
Cedola successiva	0,00000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Credit Suisse (London Branch)
Tipo obbligazione	Index Linked
Tipo tasso	Tasso Fisso + Variabile
Divisa	EUR
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	124.905.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco + Tel-quel
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	24/09/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	24/09/2014
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	24/09/2021
Data estinzione	24/09/2021
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
Euro TLX	13/02/2019	99,4600 EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
24/09/2019	0,000	0,000	Prevista	124.905.000	0	365
24/09/2020	0,000	0,000	Prevista	124.905.000	0	366
24/09/2021	0,000	0,000	Prevista	124.905.000	124.905.000	365

Annotazioni

Primo anno tasso fisso annuo del 2.00%.
 Poi annualmente verra' corrisposta una cedola pari a:
 $Cedola = VN * 2.00\% \text{ se } a > 110\% * b \text{ (2o anno)}$
 $2.30\% \text{ se } a > 110\% * b \text{ (3o anno)}$
 $2.60\% \text{ se } a > 110\% * b \text{ (4o anno)}$
 $2.80\% \text{ se } a > 110\% * b \text{ (5o anno)}$
 $3.00\% \text{ se } a > 110\% * b \text{ (6o anno)}$
 $4.00\% \text{ se } a > 110\% * b \text{ (7o anno)}$
 0.00% se Altrimenti
 Dove:
 a,b : DJEUROSTOXX 50
 a : Valore di chiusura dell'Indice rilevati annualmente il 17 settembre dal 2016 al 2021 (se non festivi)
 b : Valore di chiusura dell'Indice al 24/09/2014