

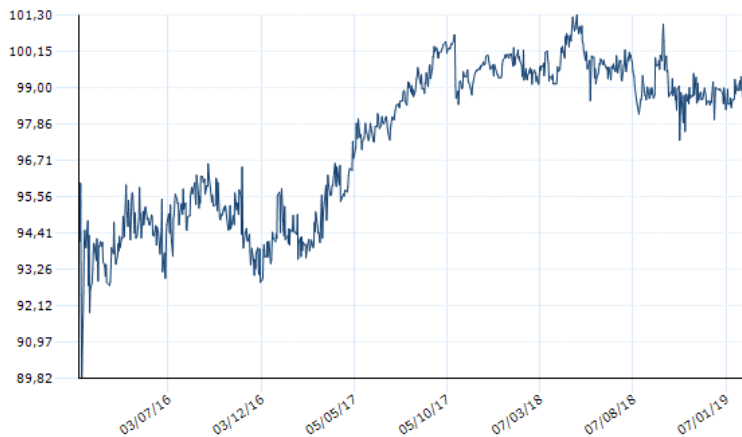
C.SUISSE LONDON DJEUROSTO 10/21 / XS1093358437
Grado di rischio calcolato

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
98,92 EUR	Credit Suisse (London Branch)	22/10/2021	0,000%	0,405%	0,405%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	98,92
Rendimento lordo	0,40525
Rendimento netto	0,40525
Cedola in corso	0,00000
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	2,68493
Duration modificata	0,67004
Convessità	1,11900
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	41.764.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco + Tel-quel
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	22/10/2014
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	22/10/2014
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	22/10/2021
Data estinzione	22/10/2021
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	98,9200	EUR

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
22/10/2019	0,000	0,000	Prevista	41.764.000	0	365
22/10/2020	0,000	0,000	Prevista	41.764.000	0	366
22/10/2021	0,000	0,000	Prevista	41.764.000	41.764.000	365

Annotazioni

Primo anno tasso fisso annuo del 2.00%.
 Poi annualmente verra' corrisposta una cedola pari a:
 Cedola= VN * 2.00% se a > 110% * b (2o anno)
 0.00% se Altrimenti
 Dove:
 a,b : DJEUROSTOXX 50
 a : Valore di chiusura dell'Indice rilevati annualmente il 15 ottobre dal 2016 al 2021 (se non festivi)
 b : Valore di chiusura dell'Indice al 22/10/2014