

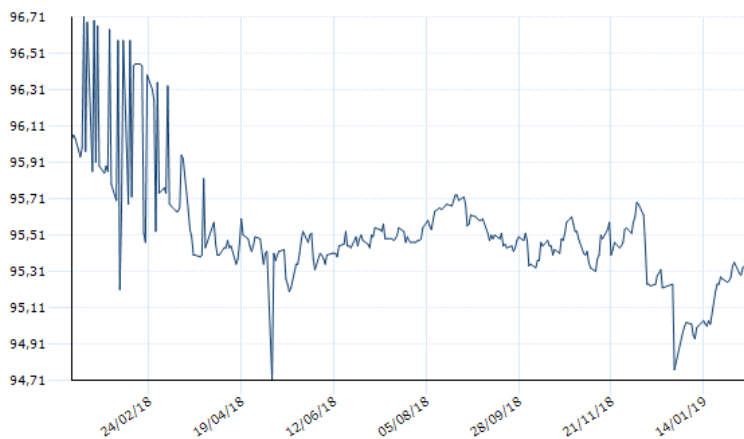
**C.SUISSE LONDON USD TF+TV 12/22 / XS1280098762**
**Grado di rischio calcolato**

|                   |   |   |   |   |   |   |   |                 |
|-------------------|---|---|---|---|---|---|---|-----------------|
| 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 |
| 95,3 USD   | Credit Suisse (London Branch) | 30/12/2022 | 0,805%          | 4,624%           | 3,739%           |


**Analisi**

|                        |            |
|------------------------|------------|
| Data ultima quotazione | 13/02/2019 |
| Data valutazione       | 13/02/2019 |
| Data valuta            | 15/02/2019 |
| Prezzo                 | 95,3       |
| Rendimento lordo       | 4,62386    |
| Rendimento netto       | 3,73853    |
| Cedola in corso        | 0,80500    |
| Rateo lordo            | 0,42039    |
| Rateo netto            | 0,31109    |
| Vita residua           | 3,87397    |
| Duration modificata    | 0,02968    |
| Convessità             | 0,03056    |
| Cedola successiva      | 0,80500    |
| Mercato di riferimento | Euro TLX   |

**Dati anagrafici principali**

|                   |                               |
|-------------------|-------------------------------|
| Ente emittente    | Credit Suisse (London Branch) |
| Tipo obbligazione | Interest Rate Linked          |
| Tipo tasso        | Tasso Fisso + Variabile       |
| Divisa            | USD                           |
| Convertibilità    | Nessuno                       |

**Mercati di quotazione**

| Mercato  | Data       | Valore Valuta |
|----------|------------|---------------|
| Euro TLX | 13/02/2019 | 95,3000 USD   |

**Caratteristiche principali**

|                                  |            |
|----------------------------------|------------|
| Nominale circolante              | 98.467.000 |
| Nominale obbligazione            | 1.000,00   |
| Taglio minimo                    | 1.000,00   |
| Corso                            | Secco      |
| Sottoscrizione                   | Regular    |
| Data emissione                   | 30/12/2015 |
| Prezzo emissione                 | 100,0000   |
| Decorrenza prima cedola regolare | 30/12/2015 |
| Frequenza cedola                 | 4          |
| Base rateo cedola                | ACT/ACT    |
| Cedola massima %                 | 1,00       |
| Subordinato                      | NO         |

**Rimborso**

|                             |                 |
|-----------------------------|-----------------|
| Tipo ammortamento           | Unica Soluzione |
| Data 1° rimborso            | 30/12/2022      |
| Data estinzione             | 30/12/2022      |
| Base rateo capitale         | Lineare         |
| Indicizzazione sul capitale | No              |
| Opzione call                | no              |
| Opzione put                 | no              |
| Prezzo di rimborso          | 100,000         |
| Regime fiscale              | Tassato 26%     |

**Formula di indicizzazione**

Primo anno tasso fisso trimestrale dello 0,9375%.  
 Poi cedole trimestrali variabili così calcolate:  
 $TV = (\text{USDLibor } 3m + 0,50)/4$  (puntuale 2gg)

**Flusso cedolare**

| Data flusso | Tasso annuo % | Val. cedola | Tipo cedola | Val. residuo | Val. ammortato | Giorni |
|-------------|---------------|-------------|-------------|--------------|----------------|--------|
| 30/03/2019  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 90     |
| 30/06/2019  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 92     |
| 30/09/2019  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 92     |
| 30/12/2019  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 91     |
| 30/03/2020  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 91     |
| 30/06/2020  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 92     |
| 30/09/2020  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 92     |
| 30/12/2020  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 91     |
| 30/03/2021  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 90     |
| 30/06/2021  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 92     |
| 30/09/2021  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 92     |
| 30/12/2021  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 91     |
| 30/03/2022  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 90     |
| 30/06/2022  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 92     |
| 30/09/2022  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 0              | 92     |
| 30/12/2022  | 0,000         | 0,805       | Prevista    | 98.467.000   | 98.467.000     | 91     |

**Indicizzazione cedole**

| Da         | A          | Descrizione indice | Peso  | Spread |
|------------|------------|--------------------|-------|--------|
| 30/12/2016 | 30/12/2022 | USDLIBOR3M         | 1,000 | 0,500  |