

C.SUISSE LONDON 3.50% 01/26 / XS1289165711
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
97,49 USD	Credit Suisse (London Branch)	26/01/2026	3,500%	3,917%	2,994%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	97,49
Rendimento lordo	3,91717
Rendimento netto	2,99374
Cedola in corso	3,50000
Rateo lordo	0,18472
Rateo netto	0,13669
Vita residua	6,95068
Duration modificata	6,03236
Convessità	44,55510
Cedola successiva	3,50000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Credit Suisse (London Branch)
Tipo obbligazione	Plain Vanilla
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	35.459.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	26/01/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	26/01/2016
Tasso annuale	3,5000
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	26/01/2026
Data estinzione	26/01/2026
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	99,6200	USD
Euro TLX	13/02/2019	97,4900	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
26/01/2020	3,500	3,500	Certa	35.459.000	0	365
26/01/2021	3,500	3,500	Certa	35.459.000	0	366
26/01/2022	3,500	3,500	Certa	35.459.000	0	365
26/01/2023	3,500	3,500	Certa	35.459.000	0	365
26/01/2024	3,500	3,500	Certa	35.459.000	0	365
26/01/2025	3,500	3,500	Certa	35.459.000	0	366
26/01/2026	3,500	3,500	Certa	35.459.000	35.459.000	365