

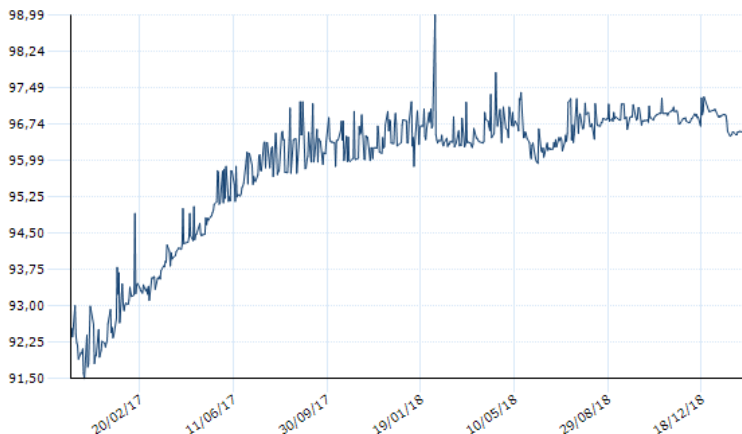
C.SUISSE LONDON USD TF+TV 08/22 / XS1396647106
Grado di rischio calcolato

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
96,66 USD	Credit Suisse (London Branch)	22/08/2022	0,755%	4,123%	3,296%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	96,66
Rendimento lordo	4,12307
Rendimento netto	3,29621
Cedola in corso	0,75470
Rateo lordo	0,69599
Rateo netto	0,51503
Vita residua	3,51781
Duration modificata	0,05062
Convessità	0,05319
Cedola successiva	0,75900
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	96,6600	USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	96.115.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	1.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	22/08/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	22/08/2016
Frequenza cedola	4
Base rateo cedola	30/360
Cedola massima %	1,00
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	22/08/2022
Data estinzione	22/08/2022
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

Primi due anni tasso fisso trimestrale dello 0.675%.
 Poi cedole trimestrali variabili così calcolate:
 $TV = (\text{USDLibor } 3m + 0.30) \text{ (puntuale } 2gg)$

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
22/02/2019	0,000	0,755	Certa	96.115.000	0	92
22/05/2019	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	89
22/08/2019	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	92
22/11/2019	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	92
22/02/2020	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	92
22/05/2020	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	90
22/08/2020	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	92
22/11/2020	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	92
22/02/2021	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	92
22/05/2021	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	89
22/08/2021	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	92
22/11/2021	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	92
22/02/2022	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	92
22/05/2022	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	0	89
22/08/2022	0,000	0,759	Prevista	96.115.000	96.115.000	92

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
22/08/2018	22/08/2022	USDLIBOR3M	1,000	0,300