

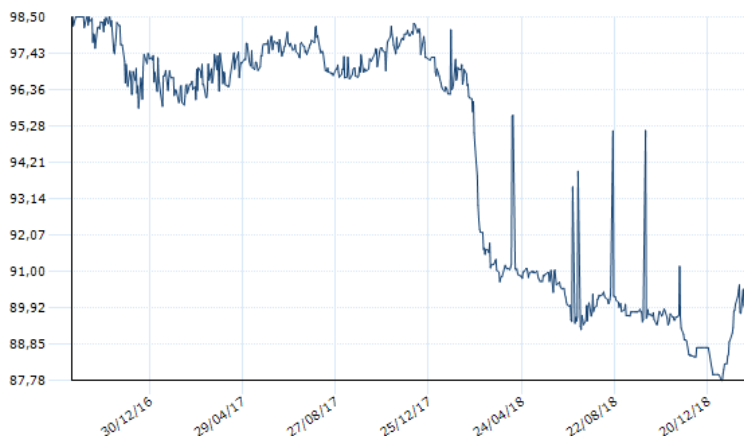
C.SUISSE LONDON AUD TF+TV 09/26 / XS1444047697
Grado di rischio calcolato

Rischio inferiore	1	2	3	4	5	6	7	Rischio elevato
-------------------	---	---	---	---	---	---	---	-----------------

Grado Liquidità

Liquido

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
90,55 AUD	Credit Suisse (London Branch)	14/09/2026	2,000%	3,633%	3,031%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	90,55
Rendimento lordo	3,63298
Rendimento netto	3,03084
Cedola in corso	2,00000
Rateo lordo	0,83889
Rateo netto	0,62078
Vita residua	7,58356
Duration modificata	0,23586
Convessità	0,29149
Cedola successiva	2,20500
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	AUD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	30.000.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	14/09/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	14/09/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Cedola minima %	2,00
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	14/09/2026
Data estinzione	14/09/2026
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	93,1300 AUD
Euro TLX	13/02/2019	90,5500 AUD

Formula di indicizzazione

Primi due anni tasso fisso annuo del 6.00%.
Poi cedole annuali variabili così calcolate:
TV= (AUB 3m) (puntuale 2gg)

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
14/09/2019	0,000	2,000	Certa	30.000.000	0	365
14/09/2020	0,000	2,205	Prevista	30.000.000	0	366
14/09/2021	0,000	2,205	Prevista	30.000.000	0	365
14/09/2022	0,000	2,205	Prevista	30.000.000	0	365
14/09/2023	0,000	2,205	Prevista	30.000.000	0	365
14/09/2024	0,000	2,205	Prevista	30.000.000	0	366
14/09/2025	0,000	2,205	Prevista	30.000.000	0	365
14/09/2026	0,000	2,205	Prevista	30.000.000	30.000.000	365

Indicizzazione cedole

Da	A	Descrizione indice	Peso	Spread
14/09/2018	14/09/2026	AUD 3M	1,000	0,000