

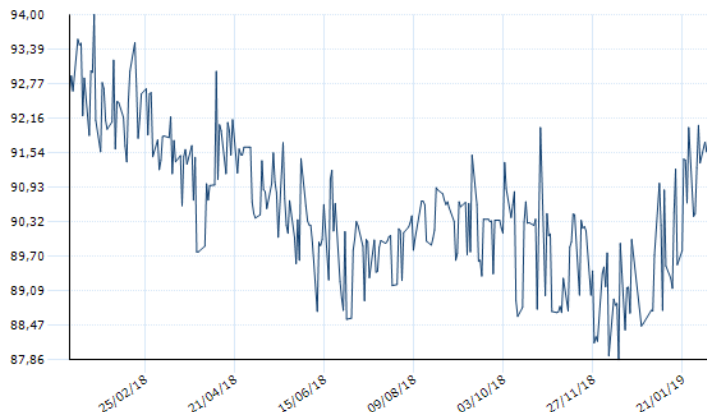
C.SUISSE LONDON Step-up 10/24 / XS1444088295
Grado di rischio calcolato

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
91,8 USD	Credit Suisse (London Branch)	31/10/2024	2,250%	4,234%	3,527%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	91,8
Rendimento lordo	4,23380
Rendimento netto	3,52735
Cedola in corso	2,25000
Rateo lordo	0,65625
Rateo netto	0,48563
Vita residua	5,71233
Duration modificata	5,13634
Convessità	32,39280
Cedola successiva	2,30000
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	38.830.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	31/10/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	31/10/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	31/10/2024
Data estinzione	31/10/2024
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Euro TLX	13/02/2019	91,8000	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
31/10/2019	2,250	2,250	Certa	38.830.000	0	365
31/10/2020	2,300	2,300	Certa	38.830.000	0	366
31/10/2021	2,500	2,500	Certa	38.830.000	0	365
31/10/2022	2,700	2,700	Certa	38.830.000	0	365
31/10/2023	2,800	2,800	Certa	38.830.000	0	365
31/10/2024	3,000	3,000	Certa	38.830.000	38.830.000	366

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call	Dal 31/10/2018	Ad ogni stacco cedola	100	10