

C.SUISSE LONDON SMI Index 12/22 / XS1494441659
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
95,91 USD	Credit Suisse (London Branch)	23/12/2022	3,088%	4,391%	3,531%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	95,91
Rendimento lordo	4,39071
Rendimento netto	3,53051
Cedola in corso	3,08760
Rateo lordo	0,00000
Rateo netto	0,00000
Vita residua	3,85479
Duration modificata	0,77804
Convessità	1,38340
Cedola successiva	3,08760
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

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

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore Valuta
Euro TLX	13/02/2019	95,9100 USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	9.154.000
Nominale obbligazione	2.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco + Tel-quel
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	23/12/2016
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	23/12/2016
Frequenza cedola	1
Base rateo cedola	ACT/ACT
Cedola massima %	6,00
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	23/12/2022
Data estinzione	23/12/2022
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	no
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
23/12/2019	0,000	3,088	Prevista	9.154.000	0	365
23/12/2020	0,000	3,088	Prevista	9.154.000	0	366
23/12/2021	0,000	3,088	Prevista	9.154.000	0	365
23/12/2022	0,000	3,088	Prevista	9.154.000	9.154.000	365

Annotazioni

Primo anno tasso fisso annuo del 3.25%.
 Poi annualmente verrà corrisposta una cedola pari a:
 $Cedola = VN * \text{Max}[0; FP * (a-b)/b]$
 Dove:
 a,b : SMI Index
 a : Valore di chiusura dell'Indice rilevato annualmente il 07/12 (se non festivo) dal 2017 al 2022
 b : Valore di chiusura dell'Indice rilevato il 23/12/2016
 FP : Fattore di Partecipazione: 2a cedola = 50%
 3a cedola = 33.33%
 4a cedola = 25%
 5a cedola = 20%
 6a cedola = 16.67%