

Quantus CHF 18 Months Callable Range Accrual Note (Indikatives Termsheet)

2.45% Coupon p.a. und 100% Kapitalschutz

Emittent	Credit Suisse (A+/Aa3)
Lead Manager	Credit Suisse
Co-Lead Manager	Quantus Asset Management
Stückelung	CHF 5'000
Zeichnungsfrist	3. Mai 2006 (12.00 Uhr MEZ)
Anfangsvaluta	8. Mai 2006
Rückzahlung	8. November 2007
Ausgabepreis	100%
Verkaufskommission	0.25%
Kapitalschutz	100%
Coupon	2.45% p.a. * (n/N)
Coupondaten	vierteljährlich
Couponbasis	30/360, unadjusted
Valorennummer	2490220
ISIN Code	XS0253059736
Handelbarkeit	täglich
LIBOR	3-monats CHF LIBOR
Verkaufsrestriktion	USA, U.S. Personen, UK

Barriertabelle

Couponperiode	Barriere
1. Quartal	1.65%
2. Quartal	1.85%
3. Quartal	2.05%
4. Quartal	2.25%
5. Quartal	2.45%
6. Quartal	2.65%

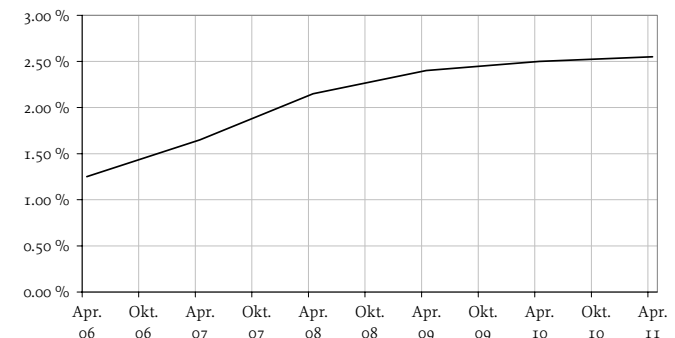
Vorteile

- Auf Verfall wird das vorgestellte Produkt durch den Emittenten zu 100% zurückbezahlt.
- Attraktive Renditeverbesserung gegenüber vergleichbaren Obligationen, wenn der 3-monats CHF LIBOR während der Laufzeit unter der entsprechenden Barriere der Couponperiode notiert.

Risiken

- Für jeden Tag, an dem der 3-monats CHF LIBOR über der entsprechenden Barriere notiert, wird kein Coupon ausbezahlt.
- Das vorgestellte Produkt kann während der Laufzeit bedeutend unter dem Rückzahlungspreis notieren.

Implizite Forward Zinskurve 3-monats CHF LIBOR



Quelle: Bloomberg

Produktbeschreibung

Die Quantus CHF 18 Months Callable Range Accrual Note ist ein strukturiertes Produkt. Es bietet Ihnen eine attraktive Alternative zu Obligationen mit der Möglichkeit, Ihre Rendite zu verbessern. Dieses Produkt ist für Sie interessant, wenn Sie davon ausgehen, dass der 3-monats CHF LIBOR nicht über die vorgegebenen Barrieren ansteigen wird.

Funktionsweise

Für jeden Tag, an dem der 3-monats CHF LIBOR bei oder unter der entsprechenden Barriere (vgl. Tabelle) schliesst, erhält der Investor einen Coupon von 2.45% p.a. Für die Tage, an denen der 3-monats CHF LIBOR über der entsprechenden Barriere notiert, zahlt die Quantus 18 Months Callable Range Accrual Note keinen Coupon.

Rückzahlung

Szenario 1: Schliesst der 3-monats CHF LIBOR an allen Tagen der Couponperiode bei oder unter der entsprechenden Barriere, erhält der Investor den vollen Coupon von 2.45%.

Szenario 2: Schliesst der 3-monats CHF LIBOR an n Tagen der Couponperiode bei oder unter der entsprechenden Barriere und an (N-n) Tagen über der Barriere, wobei N für die Anzahl Handelstage der Couponperiode steht, erhält der Investor einen Coupon von 2.45% p.a. * (n/N).

Szenario 3: Der Emittent hat das Recht, die Note erstmals am 8. August 2006 und danach an jedem weiteren Coupon-Datum vorzeitig zu pari (100%) zurückzuzahlen.

Dieses Dokument wurde von Quantus Asset Management hergestellt und ist nicht das Ergebnis einer/unserer Finanzanalyse. Daher finden die „Richtlinien zur Sicherstellung der Unabhängigkeit der Finanzanalyse“ der Schweizerischen Bankiervereinigung auf vorliegendes Dokument keine Anwendung. Das vorliegende Dokument stellt keinen Emissionsprospekt im Sinne von Art. 652a resp. Art. 1156 des Schweizerischen Obligationenrechts dar. Die im vorliegenden Dokument geäußerten Meinungen sind diejenigen der Quantus Asset Management zum Zeitpunkt der Redaktion und können jederzeit ändern. Das Dokument dient nur zu Informationszwecken und für die Verwendung des Empfängers. Es stellt weder ein Angebot noch eine Aufforderung seitens oder im Auftrag der Quantus Asset Management zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren dar. Ein Bezug auf die Performance der Vergangenheit ist nicht als Hinweis auf die Zukunft zu verstehen. Die in der vorliegende Publikation enthaltenen Informationen und Analysen wurden aus Quellen zusammengetragen, die als zuverlässig gelten. Die Quantus Asset Management gibt jedoch keine Gewähr hinsichtlich deren Zuverlässigkeit und Vollständigkeit und lehnt jede Haftung für Verluste ab, die sich aus der Verwendung dieser Informationen ergeben. Der Emittent der hier erwähnten Wertschriften hat möglicherweise aufgrund der in dieser Publikation enthaltenen Informationen und Analysen gehandelt, bevor sie den Kunden der Quantus Asset Management zugänglich gemacht wurden. Quantus Asset Management kann sich im gesetzlichen Rahmen mit dem Emittenten der hier erwähnten Wertschriften an anderen Finanzgeschäften beteiligen oder in sie investieren, Dienstleistungen erbringen oder Geschäfte von solchen Emittenten akquirieren und/oder Positionen an solchen Wertschriften oder Optionen halten oder Transaktionen damit ausführen. Die Konditionen des in diesem Dokument beschriebenen strukturierten Produkts sind nur indikativ. Quantus Asset Management behält sich das Recht vor, allfällige Mängel, die in diesem Dokument enthalten sein können, bis zum Ende der Zeichnungsfrist zu beheben. Derivative und strukturierte Produkte sind komplexe Anlageinstrumente, die typischerweise ein hohes Risiko aufweisen und nur für den Verkauf an Anleger bestimmt sind, die das damit verbundene Risiko verstehen und akzeptieren. Gestützt auf seine unabhängige Beurteilung (und allenfalls aufgrund solcher von professionellen Fachpersonen) sollte der Anleger vor Abschluss einer Transaktion sich einerseits über die Vereinbarkeit einer solchen Transaktion mit seinen Verhältnissen im Klaren sein und andererseits die besonderen finanziellen Risiken sowie die juristischen, regulatorischen, kreditmässigen, steuerlichen und buchhalterischen Konsequenzen der Transaktion in Erwägung ziehen. Weder das vorliegende Dokument noch Kopien davon dürfen in die Vereinigten Staaten versandt oder dahin mitgenommen werden oder in den Vereinigten Staaten oder an eine US-Person verteilt werden. Das vorliegende Dokument darf ohne schriftliche Genehmigung der Quantus Asset Management weder auszusweise noch vollständig vervielfältigt werden.