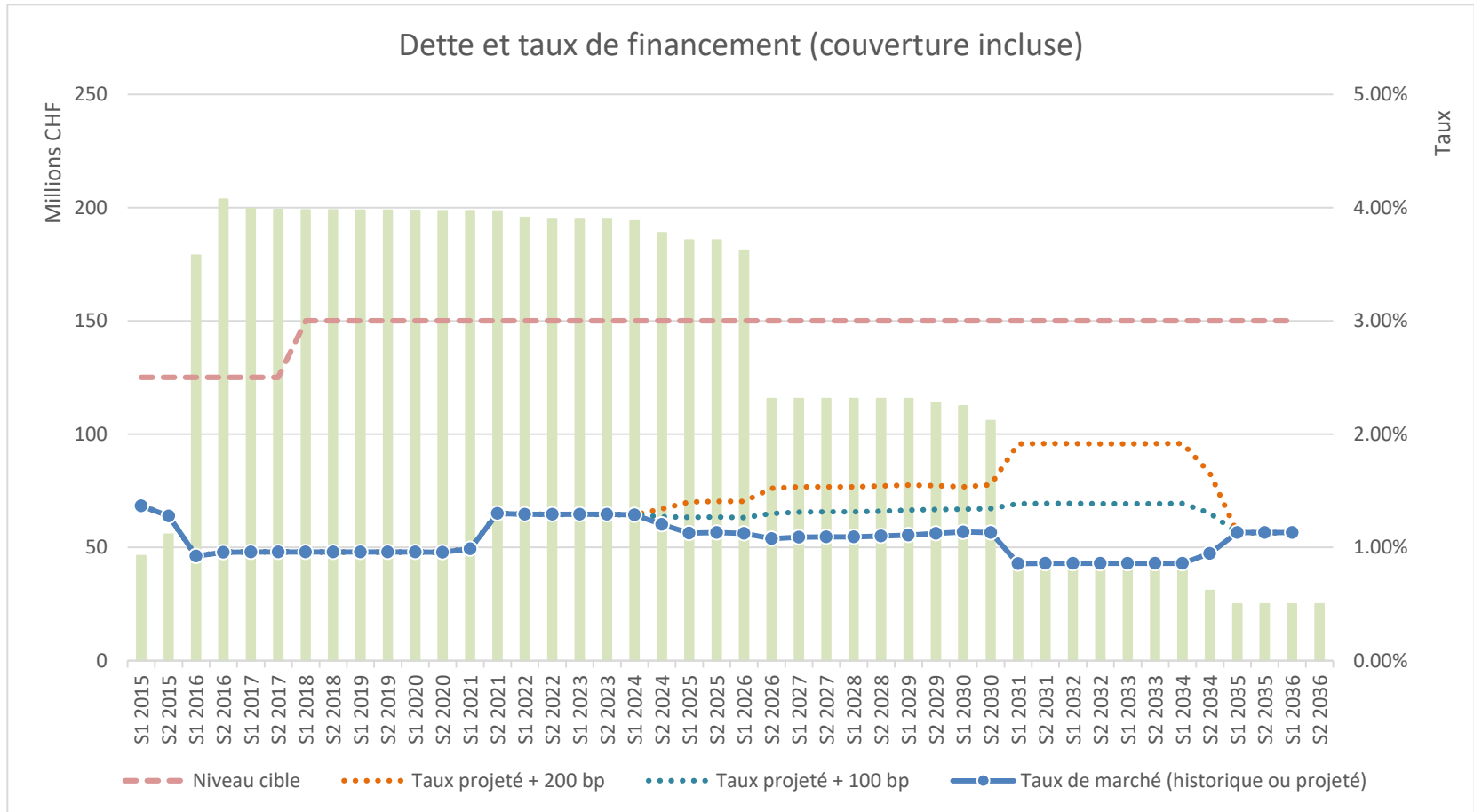
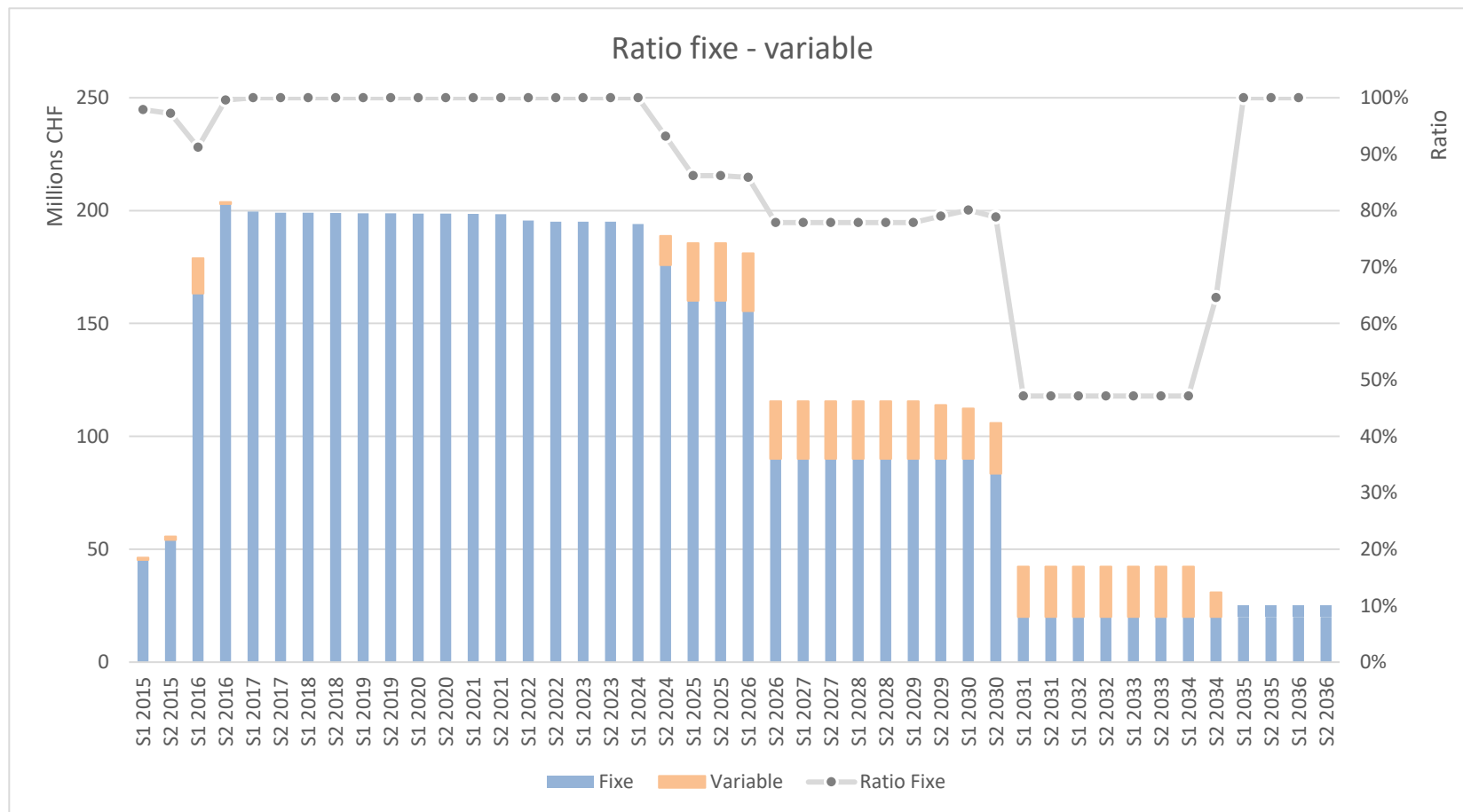
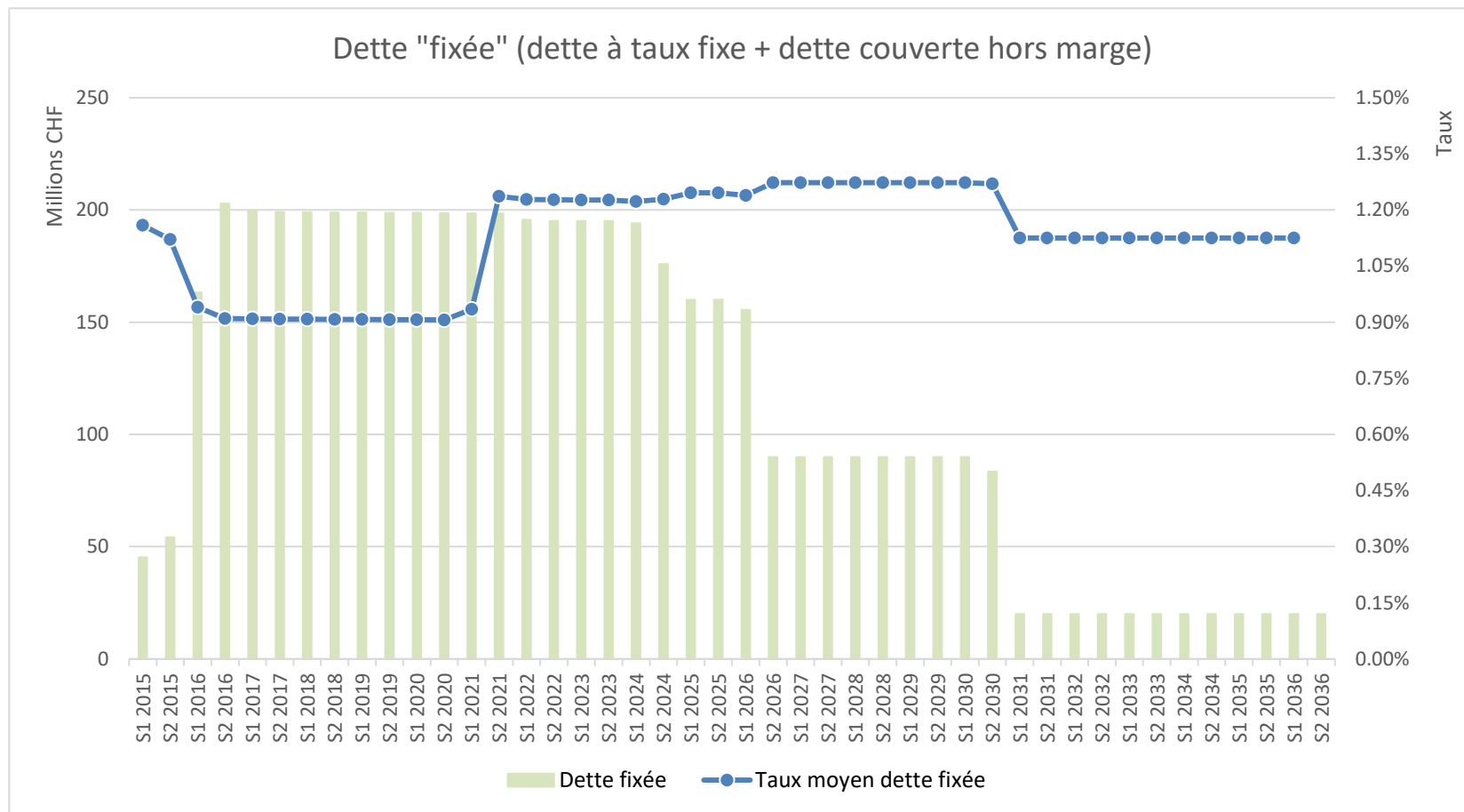


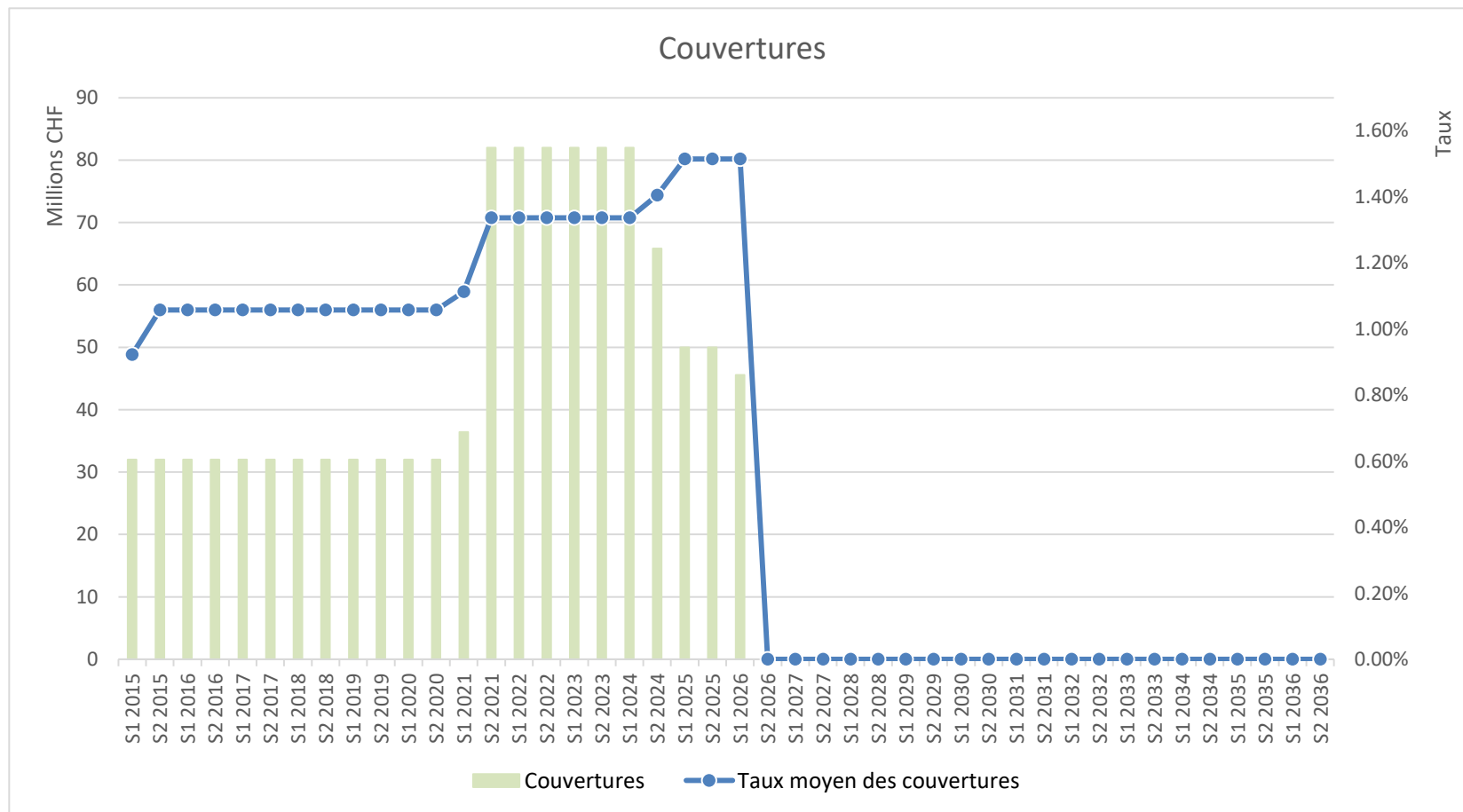
Cartographie dettes et couvertures

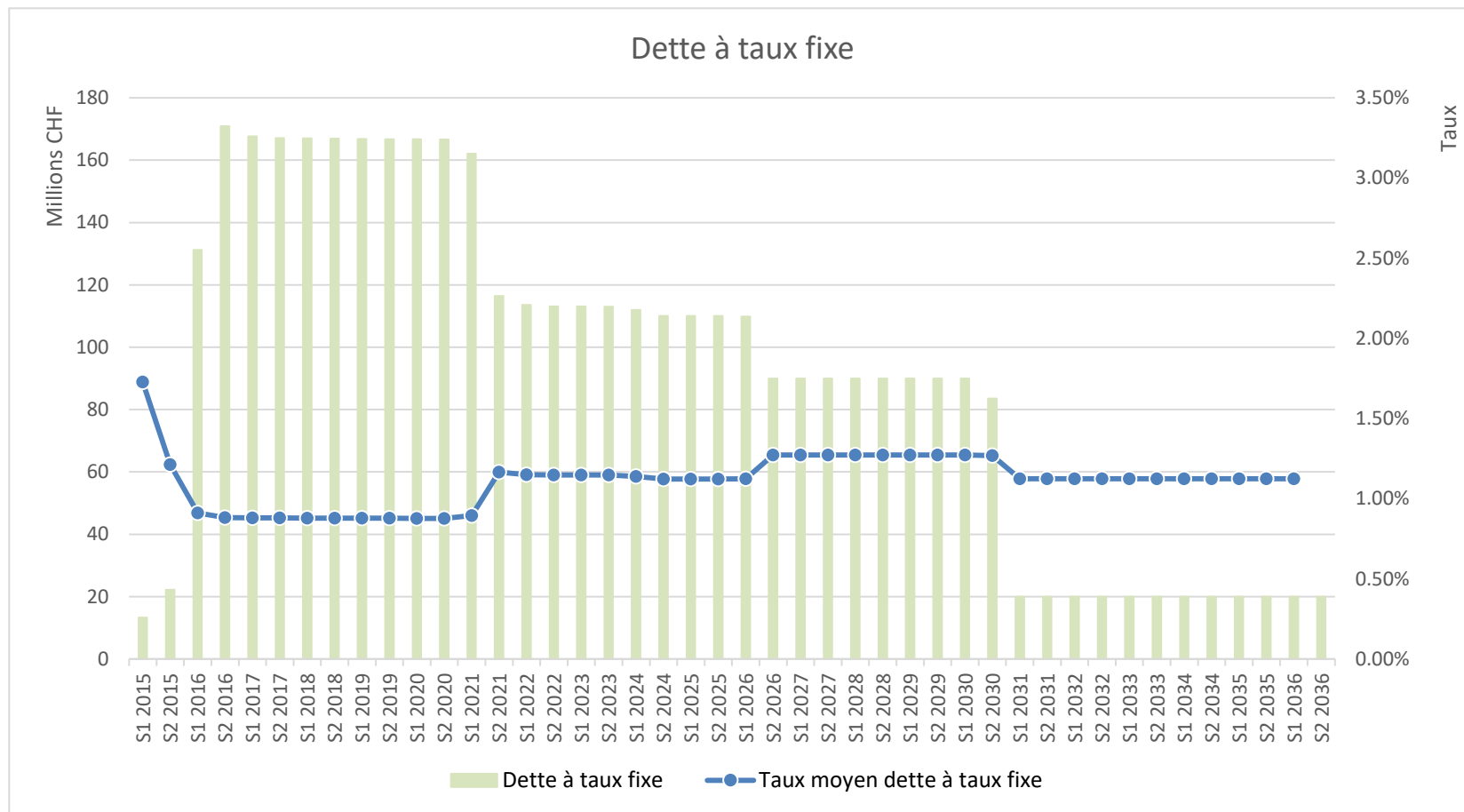
30/09/2016

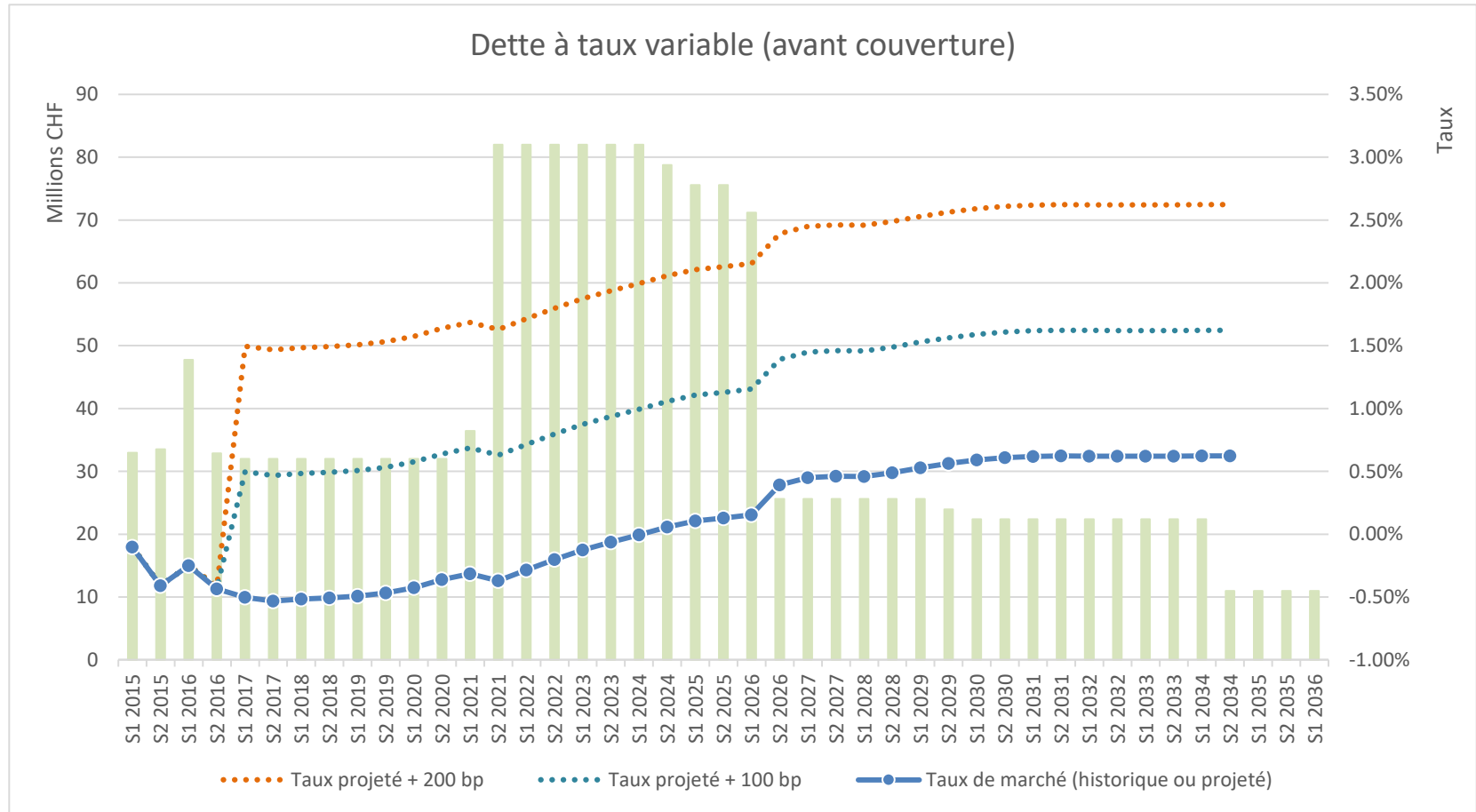












Liste des financements

Strategy ID	Link ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Notional				Fixed Rate		Floating Rate	
									CCY	Initial Amount	Current Amount	Amortizing	Rate	Day Count	Index	Credit Margin
CHFPP1	CHFPP1	PP 32M CHF	OBLIG	27-Oct-14	30-Oct-14	30-Sep-34	END	3m	CHF	32,000,000.00	32,000,000.00	VRAI			libor3MCHF	0.0032
UBS3-F	TFIX	UBS 3.8M	UBS	24-Apr-14	02-May-14	02-May-24	END	3m	CHF	3,800,000.00	3,600,000.00	VRAI	0.02	30/360		
UBS4-F	TFIX	UBS 4M	UBS	18-Jan-12	24-Jan-12	24-Jan-22	END	3m	CHF	4,000,000.00	3,620,000.00	VRAI	0.018	30/360		
BCGE1-F	TFIX	BCGE 4M	BCGE	20-Dec-11	24-Jan-12	24-Jan-17	END	3m	CHF	4,000,000.00	3,620,000.00	VRAI	0.0093	30/360		
CHFPP3	TFIX	PP 70M CHF UBS	OBLIG	26-Nov-15	15-Dec-15	15-Dec-30	END	12m	CHF	70,000,000.00	70,000,000.00	VRAI	0.01315	30/360		
CHFPP2	CHFPP2	PP 50M CHF UBS	OBLIG	26-Nov-15	15-Jun-21	15-Jun-26	END	3m	CHF	50,000,000.00		VRAI			libor3MCHF	0.0025
CHFPP2	TFIX	PP 50M CHF UBS	OBLIG	26-Nov-15	15-Dec-15	15-Jun-21	END	12m	CHF	50,000,000.00	50,000,000.00	VRAI	0.002	30/360		
CHFPP5	TFIX	PP 20M CHF 2016 inv 2	OBLIG	22-Jun-16	30-Jun-16	30-Jun-36	END	12m	CHF	20,000,000.00	20,000,000.00	VRAI	0.01125	30/360		
CHFPP4	TFIX	PP 20M CHF 2016 inv 1	OBLIG	22-Jun-16	30-Jun-16	30-Jun-26	END	12m	CHF	20,000,000.00	20,000,000.00	VRAI	0.0045	30/360		

TOTAL	203 M€
Taux fixe	171 M€
Taux variable	32 M€

Strategy ID	Trade ID	Counterparty	Trade	Effective	Maturity	Trade Type	Strike	Index	Initial Notional	Outstanding Notional	Valuation							
											CHF							
											Fair Value *	Intrinsic Value	Time Value	Fair Value **	Accrued Interests			
CHFPP1-D	8	UBS	25-Mar-15	30-Mar-15	30-Sep-24	Swap PAY	1.0575%	RECEIVE libor3MCHF	CHF	32,000,000.00	CHF	32,000,000.00	-12.41%	-3,971,096.95	-3,971,096.95	-	-3,969,961.39	-1,135.56
CHFPP2-D	14	UBS	26-Nov-15	15-Jun-21	15-Jun-26	Swap PAY	1.5150%	RECEIVE libor3MCHF	CHF	50,000,000.00	CHF	-	-7.24%	-3,618,146.19	-3,618,146.19	-	-3,618,146.19	-
											32,000,000.00		-7,589,243.14	-7,589,243.14	-	-7,588,107.58	-1,135.56	
TOTAL											32,000,000.00		-7,589,243.14	-7,589,243.14	-	-7,588,107.58	-1,135.56	

KERIUS Finance Suisse SARL
Rue Cardinal Journet 27,
1217 Meyrin - Genève, Suisse

Tel : + 41 22 566 40 52

RC Genève, numéro fédéral: CH-660-2330011-1

KERIUS Finance SAS
17 rue Dupin,
75006 Paris, France

Tel: +33 1 83 62 27 61

RC Paris: 520 300 948

Immatriculé au Registre Unique des Intermédiaire en Assurance, Banque et Finance (ORIAS) sous le n°13000716 au titre des activités de **Conseiller en Investissements Financiers**, enregistré auprès de l'Association Nationale des Conseils Financiers-CIF, association agréée par l'Autorité des Marchés Financiers .

www.kerius-finance.com

Sébastien Rouzaire
s.rouzaire@kerius-finance.com

Ce document a été préparé à l'usage des services financiers du Client. Ce document ou son contenu ne doivent pas être communiqués ou diffusés en externe sans l'accord préalable écrit de KERIUS FINANCE .

Pour ce document, KERIUS FINANCE a été amenée à utiliser des informations et données chiffrées fournies par le Client. KERIUS FINANCE a pris ces données en compte sans réaliser de procédure d'audit et n'émettra en conséquence aucune opinion sur leur fiabilité. Ce document ne constitue pas une documentation contractuelle des transactions éventuellement décrites, ni une recommandation ou une sollicitation de mettre en place les transactions décrites. Tout Client intéressé par ce type de transactions ou procédure doit mener ses propres analyses pour vérifier l'adéquation à ses besoins, ainsi que les conséquences, notamment fiscales et comptables. Il lui appartient également de prendre les dispositions nécessaires à la mise en œuvre des décisions qu'il aura prises.

Ni KERIUS FINANCE ou ses administrateurs ou employés ne pourront être tenus responsables des conséquences de l'utilisation de ce document ou de la mise en place, totale ou partielle, par le client, des idées ou opérations décrites.

This document has been prepared for the Finance department of the Client. It must not be communicated or published externally without prior written consent of KERIUS FINANCE

For this document, KERIUS FINANCE used information and data provided by the Client. The Client agrees that KERIUS FINANCE took this information into account without auditing them or checking their accuracy and, as a consequence, without producing any opinion on their reliability. Please note that this document does not constitute a contractual documentation of the transactions or processes that may be described, nor a recommendation or solicitation to enter into the transactions or processes described herein. If the Client is interested in setting up this type of transactions or processes, the Client should conduct his own analysis of the suitability to his needs. The Client must also verify the consequences of his decisions, including accounting and fiscal aspects. The Client is also responsible for the implementation of his decisions.

Neither KERIUS FINANCE nor its directors and employees accept liability for any loss or damage resulting from the use of this document and expressly excludes all liability in respect of any implication of the described ideas or transactions on the Client's own specific particulars.