

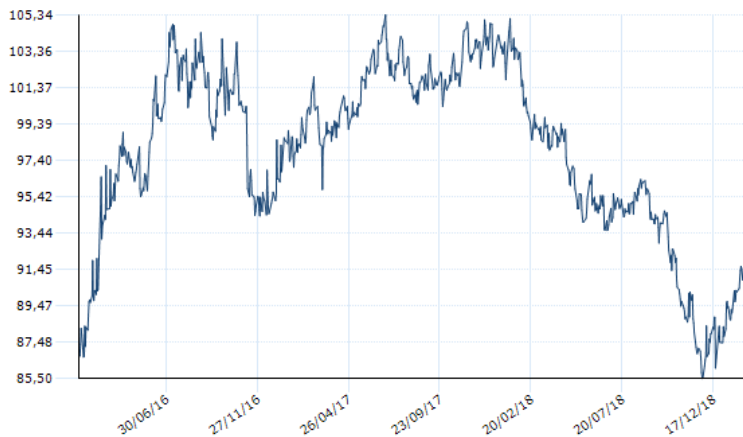
DOW CHEMICAL 4.375% 11/42 / US260543CG61
Grado di rischio calcolato

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
91,08 USD	Dow Chemical Co	15/11/2042	2,188%	5,081%	3,837%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	91,08
Rendimento lordo	5,08132
Rendimento netto	3,83719
Cedola in corso	2,18750
Rateo lordo	1,09375
Rateo netto	0,80938
Vita residua	23,76438
Duration modificata	13,68963
Convessità	267,46758
Cedola successiva	2,18750
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Dow Chemical Co
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.250.000.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	2.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	14/11/2012
Prezzo emissione	97,8400
Decorrenza prima cedola regolare	15/05/2013
Data Prorata	14/11/2012
Tasso annuale	4,3750
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	15/11/2042
Data estinzione	15/11/2042
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
Frankfurter Börse	13/02/2019	91,0800	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	90,5400	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	91,0100	USD
Börse Berlin	13/02/2019	91,0100	USD
ExtraMOT	13/02/2019	91,2500	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	90,8200	USD
Euro TLX	13/02/2019	91,4300	USD
Hi-MTF	13/02/2019	91,1000	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
15/05/2019	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	181
15/11/2019	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	184
15/05/2020	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	182
15/11/2020	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	184
15/05/2021	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	181
15/11/2021	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	184
15/05/2022	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	181
15/11/2022	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	184
15/05/2023	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	181
15/11/2023	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	184
15/05/2024	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	182
15/11/2024	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	184
15/05/2025	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	181
15/11/2025	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	184
15/05/2026	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	181
15/11/2026	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	184
15/05/2027	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	181
15/11/2027	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	184
15/05/2028	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	0	182
.....						
15/11/2042	4,375	2,188	Certa	1.250.000.000	1.250.000.000	184

Annotazioni

Callable fino al 14/05/2042 con 'make-whole' premium legato/ al Treasury Rate + 25 bp

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	14/11/2012	14/05/2042	100	30
Call dal	15/05/2042	14/11/2042	100	30