

PETROLEOS MEXICANOS 4.875% 01/22 / US71654QBB77
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
99,45 USD	Petroleos Mexicanos (Pemex)	24/01/2022	2,438%	5,141%	3,842%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	99,45
Rendimento lordo	5,14084
Rendimento netto	3,84161
Cedola in corso	2,43750
Rateo lordo	0,28438
Rateo netto	0,21044
Vita residua	2,94247
Duration modificata	2,63336
Convessità	9,70375
Cedola successiva	2,43750
Mercato di riferimento	Euro TLX

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Petroleos Mexicanos (Pemex)
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.097.055.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	10.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	24/07/2012
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	24/07/2012
Tasso annuale	4,8750
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	24/01/2022
Data estinzione	24/01/2022
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	98,9950	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	99,0400	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	99,2600	USD
Börse Berlin	13/02/2019	99,2600	USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	99,4570	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	99,2600	USD
Euro TLX	13/02/2019	99,4500	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
24/07/2019	4,875	2,438	Certa	2.097.055.000	0	181
24/01/2020	4,875	2,438	Certa	2.097.055.000	0	184
24/07/2020	4,875	2,438	Certa	2.097.055.000	0	182
24/01/2021	4,875	2,438	Certa	2.097.055.000	0	184
24/07/2021	4,875	2,438	Certa	2.097.055.000	0	181
24/01/2022	4,875	2,438	Certa	2.097.055.000	2.097.055.000	184

Annotazioni

Callable fino al 23/01/2022 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 50 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	07/09/2012	23/01/2022	100	30