

PETROLEOS MEXICANOS 5.50% 06/44 / US71654QBE17

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
81,78 USD	Petroleos Mexicanos (Pemex)	27/06/2044	2,750%	7,172%	5,467%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	81,78
Rendimento lordo	7,17244
Rendimento netto	5,46661
Cedola in corso	2,75000
Rateo lordo	0,73333
Rateo netto	0,54267
Vita residua	25,38082
Duration modificata	11,81059
Convessità	219,89879
Cedola successiva	2,75000
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

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore Valuta
Frankfurter Börse	13/02/2019	81,1100 USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	81,0000 USD
Bayerische Börse	13/02/2019	81,1000 USD
Börse Berlin	13/02/2019	81,3470 USD
ExtraMOT	13/02/2019	84,7100 USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	81,8390 USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	80,8800 USD
Euro TLX	13/02/2019	81,7800 USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	2.653.039.000
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	10.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Pro-rata
Data emissione	26/06/2012
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	27/12/2012
Data Prorata	26/06/2012
Tasso annuale	5,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	27/06/2044
Data estinzione	27/06/2044
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
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
27/06/2019	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	182
27/12/2019	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
27/06/2020	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
27/12/2020	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
27/06/2021	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	182
27/12/2021	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
27/06/2022	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	182
27/12/2022	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
27/06/2023	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	182
27/12/2023	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
27/06/2024	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
27/12/2024	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
27/06/2025	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	182
27/12/2025	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
27/06/2026	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	182
27/12/2026	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
27/06/2027	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	182
27/12/2027	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
27/06/2028	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	0	183
.....						
27/06/2044	5,500	2,750	Certa	2.653.039.000	2.653.039.000	183

Annotazioni

Callable fino al 26/06/2044 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 50 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	07/09/2012	26/06/2044	100	30