

PETROLEOS MEXICANOS 4.875% 01/24 / US71654QBH48
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
95,46 USD	Petroleos Mexicanos (Pemex)	18/01/2024	2,438%	6,038%	4,702%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	95,46
Rendimento lordo	6,03844
Rendimento netto	4,70206
Cedola in corso	2,43750
Rateo lordo	0,36563
Rateo netto	0,27056
Vita residua	4,92603
Duration modificata	4,15738
Convessità	22,45660
Cedola successiva	2,43750
Mercato di riferimento	Frankfurter Börse

Dati anagrafici principali

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

Caratteristiche principali

Nominale circolante	149.913.600
Nominale obbligazione	1.000,00
Taglio minimo	10.000,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	18/07/2013
Prezzo emissione	100,0000
Decorrenza prima cedola regolare	18/07/2013
Tasso annuale	4,8750
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	18/01/2024
Data estinzione	18/01/2024
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	95,4600	USD
Börse Düsseldorf	13/02/2019	95,4600	USD
Bayerische Börse	13/02/2019	95,4400	USD
Börse Berlin	13/02/2019	95,4400	USD
ExtraMOT	13/02/2019	96,8300	USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	96,0100	USD
Börse Stuttgart	13/02/2019	96,1400	USD
Euro TLX	13/02/2019	96,8300	USD

Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
18/07/2019	4,875	2,438	Certa	149.913.600	0	181
18/01/2020	4,875	2,438	Certa	149.913.600	0	184
18/07/2020	4,875	2,438	Certa	149.913.600	0	182
18/01/2021	4,875	2,438	Certa	149.913.600	0	184
18/07/2021	4,875	2,438	Certa	149.913.600	0	181
18/01/2022	4,875	2,438	Certa	149.913.600	0	184
18/07/2022	4,875	2,438	Certa	149.913.600	0	181
18/01/2023	4,875	2,438	Certa	149.913.600	0	184
18/07/2023	4,875	2,438	Certa	149.913.600	0	181
18/01/2024	4,875	2,438	Certa	149.913.600	149.913.600	184

Annotazioni

Callable fino al 17/01/2024 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 35 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	18/07/2013	17/01/2024	100	30