

PETROLEOS VENEZUELA 5.50% 04/37 / XS0294367205

13/02/2019	Ente emittente	Scadenza	Cedola in corso	Rendimento lordo	Rendimento netto
24,91 USD	Petroleos de Venezuela	12/04/2037	2,750%	24,698%	19,482%


Analisi

Data ultima quotazione	13/02/2019
Data valutazione	13/02/2019
Data valuta	15/02/2019
Prezzo	24,914
Rendimento lordo	24,69845
Rendimento netto	19,48243
Cedola in corso	2,75000
Rateo lordo	1,87917
Rateo netto	1,39058
Vita residua	18,16712
Duration modificata	4,06987
Convessità	36,54946
Cedola successiva	2,75000
Mercato di riferimento	Bourse de Luxembourg

Dati anagrafici principali

Ente emittente	Petroleos de Venezuela
Tipo obbligazione	Redeemable Bond
Tipo tasso	Tasso Fisso
Divisa	USD
Convertibilità	Nessuno

Mercati di quotazione

Mercato	Data	Valore	Valuta
Börse Düsseldorf	31/01/2019	24,6500	USD
Börse Berlin	31/01/2019	24,6500	USD
Bourse de Luxembourg	13/02/2019	24,9140	USD

Caratteristiche principali

Nominale circolante	1.500.000.000
Nominale obbligazione	100,00
Taglio minimo	200,00
Corso	Secco
Sottoscrizione	Regular
Data emissione	12/04/2007
Prezzo emissione	105,5000
Decorrenza prima cedola regolare	12/04/2007
Tasso annuale	5,5000
Frequenza cedola	2
Base rateo cedola	30/360
Subordinato	NO

Rimborso

Tipo ammortamento	Unica Soluzione
Data 1° rimborso	12/04/2037
Data estinzione	12/04/2037
Base rateo capitale	Lineare
Indicizzazione sul capitale	No
Opzione call	si
Opzione put	no
Prezzo di rimborso	100,000
Regime fiscale	Tassato 26%

Formula di indicizzazione
Flusso cedolare

Data flusso	Tasso annuo %	Val. cedola	Tipo cedola	Val. residuo	Val. ammortato	Giorni
12/04/2019	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	182
12/10/2019	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
12/04/2020	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
12/10/2020	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
12/04/2021	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	182
12/10/2021	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
12/04/2022	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	182
12/10/2022	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
12/04/2023	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	182
12/10/2023	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
12/04/2024	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
12/10/2024	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
12/04/2025	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	182
12/10/2025	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
12/04/2026	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	182
12/10/2026	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
12/04/2027	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	182
12/10/2027	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
12/04/2028	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	0	183
.....						
12/04/2037	5,500	2,750	Certa	1.500.000.000	1.500.000.000	182

Annotazioni

Callable fino al 11/04/2037 con 'make-whole' premium legato al Treasury Rate + 10 bp.

Call

Tipo	Dal	Al	Valore	Giorni preavviso
Call dal	12/04/2007	11/04/2037	100	30