

Ανάλυση χαρακτηριστικών ομολογιών την 30/06/2011

Ομολογίες σταθερού επιτοκίου σε ευρο

Εκδότης	ISIN	Τεμάχια	Τρέχουσα τιμή σε ευρο	Ημερομηνία έκδοσης	Ημερομηνία λήξης	Κουπόνι	Πηγή Αποτίμησης	Πιστοληπτική διαβάθμιση Moody's	Πιστοληπτική διαβάθμιση S&P	Πιστοληπτική διαβάθμιση Fitch	Πρόσθετοι όροι
ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΔΗΜΟΣΙΟ 11/3/2009-19/7/2019 6%	GR0124031650	5.000	50,875	11/03/2009	19/07/2019	6,000	BGN	Caa1	CCC	B+	
ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΔΗΜΟΣΙΟ 11/3/2010-19/6/2020 6,25%	GR0124032666	3.000	55,265	11/03/2010	19/06/2020	6,250	BGN	Caa1	CCC	B+	
ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΔΗΜΟΣΙΟ 10/11/2009-20/3/2026 5,3%	GR0133004177	5.000	47,192	10/11/2009	20/03/2026	5,300	BGN	Caa1	CCC	B+	
ΕΛΛΗΝΙΚΟ ΔΗΜΟΣΙΟ 06/2/2007-20/9/2040 4,6%	GR0138002689	5.000	43,768	06/02/2007	20/09/2040	4,600	BGN	Caa1	CCC	B+	
OTE PLC 21/11/2006-20/5/2007 4,625%	XS0275776283	6.000	83,562	21/11/2006	20/05/2016	4,625	BGN	B1	BB-	BB	
EFG HELLAS PLC11/8/2009-11/2/2013 4,375%	XS0443680052	5.000	71,534	11/08/2009	11/02/2013	4,375	BGN	B3	CCC	B+	
FCE BANK PLC 19/5/2011-19/1/2015 4,75%	XS0628597683	2.000	98,062	19/05/2011	19/01/2015	4,750	BGN	Ba2	BB	Bbe	
RENAULT S.A.25/5/2011-25/5/2016 4,625%	FR0011052117	2.000	98,777	25/05/2011	25/05/2016	4,625	BGN	Ba1	BB+	-	
NORSKE SKOGINDUSTRIER 26/6/2007-26/6/2017 7%	XS0307552355	1.000	76,017	26/06/2007	26/06/2017	7,000	BGN	B2	B-	-	
INEOS GROUP HOLDINGS PLC 07/2/2006-15/02/2016 7,875%	XS0242945367	1.000	98,139	07/02/2006	15/02/2016	7,875	BGN	Caa2	CCC	-	ΣΗΜ1

Ομολογίες κυμαινόμενου επιτοκίου σε ευρο

Εκδότης	ISIN	Τεμάχια	Τρέχουσα τιμή σε ευρο	Ημερομηνία έκδοσης	Ημερομηνία λήξης	Κουπόνι	Πηγή Αποτίμησης	Πιστοληπτική διαβάθμιση Moody's	Πιστοληπτική διαβάθμιση S&P	Πιστοληπτική διαβάθμιση Fitch	Πρόσθετοι όροι
ALPHA CREDIT GROUP PLC	XS0282533206	6.000	91,77	17/01/2007	07/01/2012	1,582	BGN	B3	CCC	B+	ΣΗΜ2
MORGAN STANLEY	XS0276891594	3.000	97,616	29/11/2006	29/11/2013	1,730	BGN	A2	A	A	ΣΗΜ3
ALPHA GROUP JERSEY LTD	DE000A0DX3M2	1.000	32,23	18/02/2005	PERPETUAL	5,892	BGN	Ca	CCC-	CCC	ΣΗΜ4
BANK OF AMERICA CORP	XS030928262	4.500	92,5	23/05/2007	23/05/2017	4,750	BGN	A3	A-	A	ΣΗΜ5

ΣΗΜΕΙΩΣΕΙΣ -ΠΡΟΣΘΕΤΟΙ ΟΡΟΙ ΟΜΟΛΟΓΩΝ

- ΣΗΜ 1
- ΣΗΜ 2
- ΣΗΜ 3
- ΣΗΜ 4
- ΣΗΜ5
- CALLABLE στις 15/8/2012 στην τιμή 103,94.
- Κουπόνι κυμαινόμενου επιτοκίου κάθε τρίμηνο.Το τρέχον κουπόνι είναι 1,582 έως 17/7/2011. Στην συνέχεια το κουπόνι γίνεται 3μηνο euribor+25 μονάδες βάσης.
- Κουπόνι κυμαινόμενου επιτοκίου κάθε τρίμηνο.Το τρέχον κουπόνι είναι 1,73 έως 29/8/2011. Στην συνέχεια το κουπόνι γίνεται 3μηνο euribor+30 μονάδες βάσης.
- CALLABLE στις 18/2/2015. Κουπόνι κυμαινόμενου επιτοκίου ετησίως. Το τρέχον επιτόκιο είναι 5,892 μέχρι τις18/2/2012.
- CALLABLE στις 23/5/2012. Κουπόνι σταθερού επιτοκίου μέχρι τις 23/5/2012, Αν δεν γίνει CALL τότε το επιτόκιο θα διαμορφωθεί σε ενός μηνός euribor+77 μονάδες βάσης.

Πηγές αποτίμησης

BGN: Bloomberg Generic prices